PIMCO

PIMCO FUNDS: GLOBAL INVESTORS SERIES PLC

Rapport annuel

31 décembre 2022

Société à responsabilité limitée, sous la forme d'une société à capital variable à responsabilité séparée entre les Fonds, immatriculée sous le numéro 276928 en vertu de la loi irlandaise de 2014 sur les sociétés (Companies Act) et agréée par la Banque centrale d'Irlande, conformément au Règlement de la Communauté européenne (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières [« OPCVM »]) de 2011, (tel que modifié).

A company of Allianz

CARACTÉRISTIQUES GÉNÉRALES

Type de Fonds :
OPCVM

Nombre de Fonds proposés par la Société :
56 Fonds

Catégories d'actions proposées par la Société au 31 décembre 2022* :
Institutions
Institutions en AUD (couverte)
Institutions en BRL (couverte)
Institutions en CAD (couverte)
Institutions en CHF (couverte)
Institutions en CHF (partiellement couverte)
Institutions en CZK (couverte)
Institutions en EUR (exposition au risque de change)
Institutions en EUR (couverte)
Institutions en EUR (partiellement couverte)
Institutions en EUR (non couverte)
Institutions en GBP (exposition au risque de change)
Institutions en GBP (couverte)
Institutions en GBP (partiellement couverte)
Institutions en GBP (non couverte)
Institutions en HKD (non couverte)
Institutions en ILS (couverte)
Institutions en JPY (couverte)
Institutions en MXN (couverte)
Institutions en NOK (couverte)
Institutions en NOK (partiellement couverte)
Institutions en NZD (couverte)
Institutions en PLN (couverte)
Institutions en RMB (couverte)
Institutions en SEK (couverte)
Institutions en SGD (couverte)
Institutions en USD (exposition au risque de change)
Institutions en USD (couverte)
Investisseurs
Investisseurs en AUD (couverte)
Investisseurs en CAD (couverte)
Investisseurs en CHF (couverte)
Investisseurs en EUR (couverte)
Investisseurs en EUR (non couverte)
Investisseurs en GBP (couverte)
Investisseurs en NOK (couverte)
Investisseurs en RMB (couverte)
Investisseurs en SEK (couverte)
Investisseurs en SGD (couverte)
Investisseurs en USD (couverte)
Administrations
Administrations en AUD (couverte)
Administrations en CHF (couverte)
Administrations en EUR (couverte)
Administrations en GBP (couverte)
Administrations en HKD (non couverte)
Administrations en JPY (couverte)
Administrations en SEK (couverte)
Administrations en SGD (couverte)
BE Détail
BM Détail
BM Détail en AUD (couverte)
BM Détail en USD (couverte)
BN Détail
Catégorie E
Catégorie E en AUD (couverte)
Catégorie E en AUD (partiellement couverte)
Catégorie E en CHF (couverte)
Catégorie E en EUR (exposition au risque de change)
Catégorie E en EUR (couverte)
Catégorie E en EUR (partiellement couverte)
Catégorie E en EUR (non couverte)
Catégorie E en GBP (couverte)
Catégorie E en GBP (partiellement couverte)
Catégorie E en HKD (non couverte)
Catégorie E en JPY (couverte)
Catégorie E en NOK (couverte)
Catégorie E en RMB (couverte)
Catégorie E en SGD (couverte)
Catégorie E en SGD (partiellement couverte)
Catégorie E en USD (exposition au risque de change)
Catégorie E en USD (couverte)
G Détail en EUR (couverte)
G Détail en EUR (non couverte)
H Institutions
H Institutions en EUR (couverte)
H Institutions en USD (exposition au risque de change)
H Institutions en USD (couverte)
M Détail
M Détail en AUD (couverte)
M Détail en HKD (non couverte)
M Détail en SEK (couverte)
M Détail en SGD (couverte)
M Détail en USD (couverte)
N Détail
Catégorie R
Catégorie R en AUD (couverte)
Catégorie R en EUR (couverte)
Catégorie R en GBP (couverte)
Catégorie T
Catégorie T en EUR (couverte)
Catégorie T en USD (couverte)
Catégorie W
Catégorie W en CAD (couverte)
Catégorie W en CHF (couverte)
Catégorie W en EUR (couverte)
Catégorie W en GBP (couverte)
Catégorie W en NOK (couverte)
Catégorie W en SEK (couverte)
Catégorie W en SGD (couverte)
Catégorie W en USD (exposition au risque de change)
Catégorie Z
Catégorie Z en AUD (couverte)
Catégorie Z en EUR (couverte)
Catégorie Z en GBP (couverte)

Types d'actions :
Dans chaque Catégorie, sous réserve du Supplément pertinent, la Société peut émettre des Actions de distribution (actions donnant droit aux bénéfices), des Actions de capitalisation (actions donnant lieu à la capitalisation des bénéfices) et des Actions de distribution II (actions cherchant à fournir un rendement amélioré).

Actif net (en milliers) :
151 524 519 USD

Participation minimale :
Les Catégories d'actions Institutions, Investisseurs, Administrations, H Institutions et W supposent une participation minimale de 500 000 USD ou l'équivalent dans la devise de la Catégorie d'actions considérée. Les Catégories d'actions BE Détail, BM Détail, BN Détail, E, G Détail, M Détail, N Détail, R et T supposent une participation minimale de 1 000 USD ou l'équivalent dans la devise de la Catégorie d'actions considérée. Les Catégories Z supposent une participation minimale de 20 millions d'USD ou l'équivalent dans la devise de la Catégorie d'actions considérée. Pacific Investment Management Company LLC (« PIMCO »), en son seul pouvoir d'appréciation, est en droit de déroger aux seuils de souscription initiale minimale et de participation minimale indiqués dans le Prospectus en vigueur.

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

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

Devise fonctionnelle des Fonds :
USD ($), sauf pour les Fonds UK Corporate Bond Fund et UK Long Term Corporate Bond Fund, libellés en livres sterling britanniques (£), et en ce qui concerne les Fonds Dynamic Multi-Asset Fund, Euro Bond Fund, Euro Credit Fund, Euro Income Bond Fund, Euro Long Average Duration Fund, Euro Short-Term Fund, PIMCO European High Yield Bond Fund et PIMCO European Short-Term Opportunities Fund, libellés en euros (€).

* Reportez-vous à la note 19 pour obtenir une liste complète des catégories d'actions actuellement émises pendant la période en cours et celle qui la précède immédiatement. Reportez-vous au Prospectus pour obtenir une liste de toutes les Catégories d'actions proposées par chaque Fonds.

CARACTÉRISTIQUES GÉNÉRALES (suite)

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

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

Devise de fonctionnement des Fonds :
USD ($), sauf pour les Fonds UK Corporate Bond Fund et UK Long Term Corporate Bond Fund, libellés en livres sterling britanniques (£), et en ce qui concerne les Fonds Dynamic Multi-Asset Fund, Euro Bond Fund, Euro Credit Fund, Euro Income Bond Fund, Euro Long Average Duration Fund, Euro Short-Term Fund, PIMCO European High Yield Bond Fund et PIMCO European Short-Term Opportunities Fund, libellés en euros (€).

(Cette page est laissée vierge volontairement)

CARACTÉRISTIQUES GÉNÉRALES (suite)

Autorisation à Hong Kong :

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

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

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

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

Autorisation à Singapour

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

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

Page Reuters :

PAFPPLC

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

Sommaire

	Page
La lettre du Président*	4
Informations importantes concernant les Fonds	5
Description des indices de référence	67
Bilan	72
Compte de Résultat	92
État de l'évolution des actifs nets	112
Tableau des investissements	118
Notes relatives aux États financiers	730
Rapport des Administrateurs	859
Rapport des Commissaires aux comptes indépendants	862
Rapport du Dépositaire	867
Éléments fournis concernant les rémunérations (non audités)	868
Variations importantes de la composition du portefeuille (non auditées)	869
Directive sur les droits des actionnaires II (SRD II) (non auditée)	926
Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers et du Règlement sur la taxonomie (non auditées)	927
Glossaire (non audité)	1026
Informations générales (non auditées)	1028

FONDS	Synthèse des Fonds*	Tableau des investissements
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	6	118
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	7	126
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	8	134
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	10	142
Fonds Commodity Real Return Fund	11	149
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	12	159
Fonds Diversified Income Fund	13	168
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	15	185
Fonds Diversified Income ESG Fund	16	195
Fonds Dynamic Bond Fund	17	199
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	18	216
Fonds Emerging Local Bond Fund	19	228
Fonds Emerging Local Bond ESG Fund	20	249
Fonds Emerging Markets Bond Fund	21	255
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	22	270
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	23	284
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	24	291
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	25	303
Fonds PIMCO ESG Income Fund	26	316
Fonds Euro Bond Fund	27	327
Fonds Euro Credit Fund	28	335
Fonds Euro Income Bond Fund	29	342
Fonds Euro Long Average Duration Fund	30	350
Fonds Euro Short-Term Fund	31	356
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	32	361
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	33	367
Fonds Global Advantage Fund	34	374
Fonds Global Bond Fund	35	392
Fonds Global Bond ESG Fund	37	416
Fonds Global Bond Ex-US Fund	38	433
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	39	449
Fonds Global High Yield Bond Fund	40	461
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	41	470
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	43	491
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	44	503
Fonds Global Real Return Fund	45	511

FONDS	Synthèse des Fonds*	Tableau des investissements
Fonds Income Fund	46	521
Fonds Income Fund II	48	558
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	49	565
Fonds Low Average Duration Fund	50	574
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	51	582
Fonds Low Duration Income Fund	52	592
Fonds Low Duration Opportunities Fund	53	606
Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund	54	618
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	55	621
Fonds Mortgage Opportunities Fund	56	624
Fonds StocksPLUS™ Fund	57	633
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	58	640
Fonds Strategic Income Fund	59	645
Fonds Total Return Bond Fund	60	661
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	61	674
Fonds UK Corporate Bond Fund	62	689
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	63	697
Fonds US High Yield Bond Fund	64	705
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	65	713
Fonds US Short-Term Fund	66	723

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

* Le présent document contient les opinions de la Société, lesquelles peuvent changer sans préavis. Ce document a été diffusé à des fins d'information seulement. Les prévisions, estimations et certaines informations contenues dans les présentes se fondent sur des travaux de recherche exclusifs et ne doivent pas être considérées comme valant conseil d'investissement ou recommandation d'un titre, d'une stratégie ou d'un produit d'investissement particulier. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré. Les informations contenues dans les présentes ont été obtenues de sources considérées comme fiables, mais non garanties. Aucune partie du présent document ne peut être reproduite, sous quelque forme que ce soit, ni évoquée dans une autre publication sans permission expresse écrite. PIMCO est une marque déposée d'Allianz Asset Management of America LLC, protégée aux États-Unis et dans le monde entier. ©2023, PIMCO.

La lettre du Président

Cher Actionnaire,

L'année 2022 a été une année difficile sur les marchés financiers. Nous continuons à travailler sans relâche pour tirer le meilleur parti des turbulences des marchés mondiaux et gérer les actifs que vous nous avez confiés. Après cette lettre se trouve le Rapport annuel de PIMCO Funds: Global Investors Series plc pour la période comptable de douze mois close le 31 décembre 2022 (la « période comptable »). Vous trouverez dans les pages suivantes les renseignements afférents aux résultats d'investissement et une discussion concernant les facteurs ayant eu un impact important sur la performance au cours de la période comptable.

Pour la période comptable de douze mois close le 31 décembre 2022

L'économie mondiale a été confrontée à d'importants vents contraires en 2022, notamment ceux liés à la hausse de l'inflation, à la pandémie de COVID-19 et au conflit entre la Russie et l'Ukraine. Dans sa mise à jour des Perspectives de l'économie mondiale d'octobre 2022, le Fonds monétaire international (« FMI ») a revu à la baisse ses prévisions de PIB pour 2022, invoquant des « turbulences difficiles à négocier » telles que l'inflation élevée, le durcissement des conditions financières, le conflit entre la Russie et l'Ukraine et la pandémie de COVID-19. Pour 2022, le FMI a inclus dans ses prévisions une croissance du PIB de 1,6 % aux États-Unis (contre 5,7 % en 2021), 3,1 % dans la zone euro (contre 5,2 % en 2021), 3,6 % au Royaume-Uni (contre 7,4 % en 2021) et 1,7 % au Japon (comme en 2021).

Plusieurs banques centrales ont resserré leurs politiques monétaires ces dernières années. Par exemple, en décembre 2021, avant le début de la période comptable, la Banque d'Angleterre a relevé ses taux pour la première fois depuis le début de la pandémie de COVID-19. La Banque d'Angleterre a de nouveau relevé ses taux lors de ses huit réunions suivantes, soit une hausse totale de 3,50 % depuis le premier relèvement. La Banque centrale européenne a relevé ses taux quatre fois en 2022, soit une hausse totale de 2,50 %. En revanche, la Banque du Japon a maintenu sa politique monétaire souple pendant la majeure partie de 2022. Toutefois, en décembre 2022, la Banque du Japon a annoncé qu'elle relèverait à 0,5 % le plafond du rendement de ses obligations d'État à 10 ans (auparavant limité à 0,25 %). Cette annonce a fait grimper le rendement des obligations à 10 ans et le yen japonais, les acteurs du marché y voyant une indication que la Banque du Japon pourrait réorienter sa politique monétaire.

Le Conseil de la Réserve fédérale (la « Fed » ou « Banque centrale américaine ») a pris des mesures pour endiguer l'inflation élevée. En mars 2022, la Fed a relevé le taux des fonds fédéraux de 0,25 % pour l'inscrire dans une fourchette allant de 0,25 % à 0,50 %, appliquant sa première hausse depuis 2018. La Banque centrale américaine a ensuite relevé ses taux au cours de ses six réunions suivantes, avec une hausse totale de 4,25 % en 2022. À la fin de l'année, le taux des fonds fédéraux se situait dans une fourchette allant de 4,25 % à 4,50 %.

Au cours de la période comptable, les rendements des bons du Trésor américain à court et long termes ont fortement augmenté. Le rendement du bon du Trésor américain à 10 ans, titre de référence, était de 3,88 % le 31 décembre 2022, contre 1,52 % le 31 décembre 2021. L'Indice Bloomberg Global Treasury Index (couvert en USD), qui réplique la dette publique en devise locale à taux fixe de pays de qualité « investment grade », tant développés qu'émergents, a accusé un recul de -10,79 %. En parallèle, l'Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD), un indice largement utilisé d'obligations mondiales de qualité « investment grade », a enregistré une baisse de -14,22 %. Les catégories d'actifs à revenu fixe plus risquées, y compris les obligations d'entreprise à haut rendement et la dette des marchés émergents, ont également produit des résultats médiocres. L'Indice ICE BofA Merrill Lynch Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en USD), un indice largement utilisé d'obligations dont la notation est inférieure à la qualité « investment grade », a dégagé un rendement de -10,56 %, alors que la dette extérieure des marchés émergents, telle que représentée par l'Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en USD), affichait un rendement de -16,45 %. Les obligations locales des marchés émergents, représentées par l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert), ont dégagé un rendement de -11,69 %.

Dans un contexte marqué par des épisodes de volatilité, les actions mondiales ont généralement affiché des résultats médiocres au cours de la période comptable, les préoccupations économiques et géopolitiques ayant pesé sur la confiance des investisseurs. Les actions américaines, mesurées par l'Indice S&P 500 Index, ont dégagé un rendement de -18,11 %. Les actions mondiales, mesurées par l'Indice MSCI World Index, ont dégagé un rendement de -18,14 %, contre -20,09 % pour les actions des marchés émergents, représentées par l'Indice MSCI Emerging Markets Index. Dans le même temps, les actions japonaises, telles que représentées par l'Indice Nikkei 225 Index (en yen japonais), ont dégagé un rendement de -7,37 % et les actions européennes, telles que représentées par l'Indice MSCI Europe Index (en euro), ont dégagé un rendement de -9,49 %.

Les prix des matières premières ont été volatils et ont généré des rendements mitigés au cours de la période comptable. Le cours du baril de Brent, qui s'élevait à environ 77,24 $ au début de la période comptable, est passé à environ 82,82 $ fin décembre 2022. Les prix des autres matières premières, telles que le cuivre et l'or, ont baissé au cours de la période.

Enfin, les marchés des changes ont eux aussi traversé des épisodes de volatilité. Nous pensons que cela a résulté de plusieurs facteurs, notamment les prévisions de croissance économique et la réorientation des politiques monétaires des banques centrales, ainsi que la hausse de l'inflation, les variants de la COVID-19 et les événements géopolitiques. Le dollar américain s'est raffermi face à plusieurs grandes devises. Par exemple, pendant la période comptable, le dollar américain a dégagé un rendement de 5,85 %, 10,71 % et 12,23 % par rapport à l'euro, à la livre sterling et au yen japonais, respectivement.

Nous vous remercions pour les actifs que vous avez placés auprès de PIMCO. Votre confiance est pour nous très précieuse et nous poursuivrons nos efforts pour répondre à vos besoins en investissement les plus étendus. Si vous avez des questions relatives à vos investissements PIMCO Funds: Global Investors Series plc, veuillez contacter l'Agent administratif au **+353 (1) 776 9990.**

Cordialement,

Craig A. Dawson
Président

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

Informations importantes concernant les Fonds

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

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

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

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

Les classifications des participations du portefeuille du Fonds dans le présent rapport sont effectuées conformément aux règlementations relatives à l'information financière. La classification des participations d'un portefeuille particulier comme indiquée dans les sections Tableau des investissements du présent rapport peut différer de la classification utilisée pour les calculs de conformité du Fonds, notamment celle utilisée dans le Prospectus, les objectifs d'investissement et les politiques et limites d'investissements réglementaires et autres, qui peut être basée sur différentes classifications géographique, sectorielle ou de catégories d'actifs. Tous les Fonds sont suivis indépendamment à des fins de conformité en ce qui concerne le Prospectus et les exigences réglementaires.

Dans le Tableau des investissements, les participations spécifiques au portefeuille peuvent être agrégées lorsque les investissements ont les mêmes attributs (taux de coupon et dates d'échéance).

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

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

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

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

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

Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 14 février 2019)	(14,01 %)	(2,96 %)
Institutions, distribution (lancement le 14 février 2019)	(13,98 %)	(2,94 %)
Investisseurs, capitalisation (lancement le 25 mai 2021)	(14,38 %)	(16,43 %)
Investisseurs, distribution (lancement le 20 août 2020)	(14,34 %)	(9,21 %)
Administrations, distribution (lancement le 14 février 2019)	(14,41 %)	(3,43 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 1er juillet 2020)	(14,81 %)	(7,76 %)
Catégorie E, distribution (lancement le 14 février 2019)	(14,76 %)	(3,81 %)
H Institutions, capitalisation (lancement le 12 mars 2021)	(14,17 %)	(13,54 %)
H Institutions, distribution (lancement le 12 mars 2021)	(14,09 %)	(13,50 %)
M Détail, distribution II (lancement le 14 février 2019)	(14,87 %)	(3,83 %)
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 14 février 2019)	(13,46 %)	(2,32 %)
Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index	(15,09 %)	(3,89 %)[2]
Catégories libellées en AUD		
Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 30 juillet 2021)	(14,52 %)	(15,55 %)
Investisseurs en AUD (couverte), distribution (lancement le 30 septembre 2020)	(14,91 %)	(9,70 %)
Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en AUD)	(16,72 %)	(11,19 %)[2]
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 23 octobre 2020)	(15,98 %)	(10,83 %)
Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 23 octobre 2020)	(15,95 %)	(10,82 %)
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 23 octobre 2020)	(16,70 %)	(11,62 %)
Catégorie E en CHF (couverte), distribution (lancement le 23 octobre 2020)	(16,70 %)	(11,62 %)
Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en CHF)	(17,93 %)	(12,34 %)
Catégories libellées en CNH		
Investisseurs en RMB (couverte), distribution (lancement le 9 octobre 2020)	(14,09 %)	(8,23 %)
Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en CNH)	(15,49 %)	(9,39 %)
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 septembre 2020)	(15,81 %)	(10,23 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 septembre 2020)	(15,80 %)	(10,19 %)
Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 10 septembre 2020)	(16,06 %)	(11,02 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 septembre 2020)	(16,61 %)	(11,00 %)
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 septembre 2020)	(16,54 %)	(10,99 %)
Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en EUR)	(17,65 %)	(12,33 %)[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 29 juillet 2021)	(14,33 %)	(15,78 %)
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 6 mai 2021)	(14,26 %)	(15,72 %)
Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en GBP)	(16,13 %)	(17,42 %)[2]
Catégories libellées en HKD		
Catégorie E en HKD (non couverte), distribution (lancement le 14 février 2019)	(14,63 %)	(3,92 %)
M Détail en HKD (non couverte), distribution II (lancement le 14 février 2019)	(14,64 %)	(3,94 %)
Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (non couvert en HKD)	(15,00 %)	(4,03 %)
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 30 juillet 2021)	(14,05 %)	(15,16 %)
Investisseurs en SGD (couverte), distribution (lancement le 20 août 2020)	(14,33 %)	(9,21 %)
Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 14 février 2019)	(14,83 %)	(4,06 %)
M Détail en SGD (couverte), distribution II (lancement le 14 février 2019)	(14,83 %)	(4,05 %)
Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index (couvert en SGD)	(15,67 %)	(4,34 %)[2]

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sous-pondération du positionnement sur la duration américaine a contribué à la performance relative, les taux ayant augmenté au cours de la période.

» La sélection de crédit au sein des entreprises indiennes a contribué à la performance relative, notamment dans le secteur des services aux collectivités.

» La sélection de crédit dans d'autres entreprises asiatiques des marchés émergents a contribué à la performance relative, en particulier à Hong Kong, aux Philippines et à Singapour.

» La sélection de crédit au sein des entreprises chinoises a pesé sur la performance relative, notamment en raison d'une exposition au secteur immobilier et de la surpondération d'une entreprise de fabrication diversifiée triée sur le volet.

» L'exposition à certains crédits d'entreprises indonésiennes a nui à la performance relative, en particulier dans les secteurs industriel et financier.

Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, distribution (lancement le 4 septembre 2020)	(10,27 %)	(5,41 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 4 septembre 2020)	(11,04 %)	(6,19 %)
Catégorie E, distribution (lancement le 1er juin 2010)	(11,06 %)	2,29 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 1er décembre 2020)	(9,65 %)	(5,95 %)
Indice JPMorgan Asia Credit Index[3]	(11,02 %)	2,99 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 5 mars 2021)	(12,12 %)	(9,04 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 5 mars 2021)	(12,83 %)	(9,77 %)
Indice JPMorgan Asia Credit Index (couvert en EUR)[3]	(13,21 %)	(8,58 %)
Catégories libellées en EUR (non couvertes)		
Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 3 juin 2011)	(5,22 %)	3,05 %
Indice JPMorgan Asia Credit Index (non couvert en EUR)[3]	(5,19 %)	4,25 %
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 13 août 2021)	(10,64 %)	(10,93 %)
Indice JPMorgan Asia Credit Index (couvert en GBP)[3]	(11,89 %)	(10,35 %)
Catégories libellées en HKD		
Catégorie E en HKD (non couverte), distribution (lancement le 4 septembre 2020)	(10,94 %)	(5,91 %)
M Détail en HKD (non couverte), distribution (lancement le 1er mars 2011)	(10,87 %)	0,85 %
Indice JPMorgan Asia Credit Index (non couvert en HKD)[3]	(11,01 %)	1,83 %[2]
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 9 octobre 2020)	(10,31 %)	(5,28 %)
Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 9 octobre 2020)	(11,07 %)	(6,08 %)
Indice JPMorgan Asia Credit Index (couvert en SGD)[3]	(11,33 %)	(5,62 %)

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

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» Le positionnement en devises a contribué à la performance absolue.

» L'exposition aux crédits d'entreprise à haut rendement hors Chine/Hong Kong a contribué à la performance absolue, notamment au sein du secteur des jeux de hasard à Macao.

» Le positionnement sur la duration américaine a nui à la performance absolue, les taux ayant augmenté au cours de la période.

» L'exposition aux crédits d'entreprise à haut rendement de Chine et de Hong Kong a nui à la performance absolue, notamment en raison du secteur immobilier chinois.

» L'exposition aux obligations souveraines asiatiques a pesé sur la performance absolue, notamment en raison du Pakistan et du Sri Lanka.

Fonds PIMCO Capital Securities Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 juillet 2013)	(11,53 %)	4,72 %
Institutions, distribution (lancement le 23 septembre 2014)	(11,56 %)	3,78 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 19 mai 2014)	(11,86 %)	3,36 %
Investisseurs, distribution (lancement le 19 mai 2014)	(11,87 %)	3,37 %
Administrations, capitalisation (lancement le 9 août 2013)	(11,97 %)	4,12 %
Administrations, distribution (lancement le 9 août 2013)	(11,97 %)	4,12 %
Administrations, distribution II (lancement le 12 août 2022)	—	(1,97 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 28 octobre 2013)	(12,32 %)	3,47 %
Catégorie E, distribution (lancement le 19 mai 2014)	(12,27 %)	2,82 %
M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013)	(12,37 %)	3,23 %
Catégorie R, distribution (lancement le 18 mars 2014)	(11,61 %)	3,72 %
Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014)	(12,67 %)	2,76 %
Catégorie Z, distribution (lancement le 31 octobre 2013)	(10,78 %)	5,18 %
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index[3]	1,78 %	1,07 %[2]
Catégories libellées en AUD		
Investisseurs en AUD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018)	(12,77 %)	1,18 %
Catégorie Z en AUD (couverte), distribution (lancement le 11 août 2015)	(11,84 %)	4,06 %
Indice Bloomberg AusBond Bank Bills Index	1,25 %	1,32 %[2]
Catégories libellées en BRL		
Institutions en BRL (couverte), capitalisation (lancement le 2 janvier 2018)	2,48 %	(3,71 %)
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en BRL)[3]	17,91 %	(3,81 %)
Catégories libellées en CAD		
Investisseurs en CAD (couverte), distribution (lancement le 25 juin 2018)	(12,04 %)	1,92 %
Taux des mises en pension au jour le jour canadien (CORRA)[4]	1,61 %	1,17 %
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 9 août 2013)	(13,77 %)	2,61 %
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 juin 2014)	(14,54 %)	0,46 %
Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index[5]	(0,24 %)	(0,79 %)[2]
Catégories libellées en CNH		
Investisseurs en RMB (couverte), distribution (lancement le 25 juin 2018)	(11,55 %)	3,76 %
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en RMB)[3]	2,07 %	2,77 %
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 9 août 2013)	(13,44 %)	2,99 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 9 août 2013)	(13,49 %)	3,00 %
Institutions en EUR (couverte), distribution II (lancement le 29 juillet 2014)	(13,51 %)	1,87 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 26 février 2016)	(13,80 %)	2,46 %
Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 9 août 2013)	(13,92 %)	2,47 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 octobre 2013)	(14,26 %)	1,80 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015)	(14,31 %)	0,75 %
Catégorie R en EUR (couverte), distribution (lancement le 18 juin 2014)	(13,66 %)	1,62 %
Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)	(14,58 %)	0,78 %
Taux à court terme en euro (ESTER)[6]	0,02 %	(0,20 %)[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 9 août 2013)	(12,20 %)	3,73 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 31 juillet 2013)	(12,27 %)	3,80 %
Investisseurs en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2020)	(12,50 %)	(2,32 %)
Catégorie R en GBP (couverte), distribution (lancement le 18 juin 2014)	(12,36 %)	2,38 %
Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index[7]	1,42 %	0,59 %[2]

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» Certaines positions de swaps de taux d'intérêt ont contribué à la performance.

» L'exposition à la dette senior et de niveau 2 (Tier 2) d'une banque italienne qui a surperformé après avoir obtenu une levée de capital a contribué à la performance.

» L'exposition et la sélection de titres au sein des obligations supplémentaires de niveau 1 (Additional Tier 1, AT1) et des obligations hybrides subordonnées, en particulier aux AT1 d'une banque suisse et aux obligations perpétuelles de certains émetteurs néerlandais et britanniques, qui ont sous-performé, ont nui à la performance.

» L'exposition tactique aux titres hybrides d'entreprises et non financiers a pesé sur la performance, puisque les écarts se sont creusés.

» L'exposition et la sélection de titres au sein des obligations de niveau 2 et des obligations contingentes convertibles, en particulier de certains émetteurs français, ont nui à la performance.

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1] (suite)

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en HKD		
M Détail en HKD (non couverte), distribution (lancement le 28 juillet 2017)	(12,27 %)	1,62 %
Indice HIBOR Index à 3 mois	1,49 %	1,37 %
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 30 juillet 2021)	(11,68 %)	(8,08 %)
Investisseurs en SGD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018)	(12,02 %)	1,77 %
Administrations en SGD (couverte), distribution II (lancement le 12 août 2022)	—	(2,10 %)
M Détail en SGD (couverte), distribution II (lancement le 23 décembre 2013)	(12,53 %)	3,05 %
Taux moyen interbancaire au jour le jour de Singapour SORA[8]	1,71 %	1,08 %[2]

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

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

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

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

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

6 *La performance par rapport à l'indice de référence du Fonds PIMCO Capital Securities Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice Euribor à 3 mois ; à partir du 1er juillet 2021 : Taux à court terme en euro (ESTER).*

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

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

Fonds PIMCO Climate Bond Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 23 septembre 2020)	(12,76 %)	(5,38 %)
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 23 septembre 2020)	(12,28 %)	(4,86 %)
Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en USD)	(17,01 %)	(8,23 %)
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 13 novembre 2020)	(15,04 %)	(7,75 %)
Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en CHF)	(19,42 %)	(10,86 %)
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 23 septembre 2020)	(14,60 %)	(6,71 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 2 décembre 2020)	(14,63 %)	(7,72 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 23 septembre 2020)	(15,37 %)	(7,54 %)
Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en EUR)	(18,98 %)	(9,64 %)[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 23 septembre 2020)	(13,49 %)	(5,85 %)
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 avril 2021)	(13,55 %)	(8,11 %)
Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en GBP)	(18,11 %)	(8,87 %)[2]
Catégories libellées en SEK		
Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2021)	(14,25 %)	(10,09 %)
Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 8 octobre 2021)	(14,66 %)	(12,52 %)
Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en SEK)	(18,86 %)	(13,24 %)[2]
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 26 février 2021)	(12,90 %)	(6,81 %)
Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en SGD)	(17,29 %)	(9,76 %)

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» Le positionnement sur les principaux taux européens a contribué à la performance absolue, les rendements ayant augmenté.

» Il n'y a pas eu d'autres contributeurs importants pour ce Fonds.

» L'exposition longue à la duration des marchés développés a nui à la performance absolue, en particulier aux États-Unis, les rendements ayant augmenté.

» L'exposition longue au crédit d'entreprise a pesé sur la performance absolue, puisque les écarts se sont creusés.

» L'exposition longue à la dette extérieure des marchés émergents a nui à la performance absolue, puisque les écarts se sont creusés.

Fonds Commodity Real Return Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 août 2006)	10,79 %	(0,22 %)
Investisseurs, capitalisation (lancement le 11 août 2011)	10,49 %	(1,60 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 21 septembre 2007)	9,82 %	(1,53 %)
H Institutions, capitalisation (lancement le 29 avril 2022)	—	(15,40 %)
Indice Bloomberg Commodity Index Total Return	16,09 %	(1,54 %)[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 8 juin 2010)	8,55 %	(0,50 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 7 mars 2012)	7,63 %	(3,00 %)
Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (couvert en EUR)	13,76 %	(1,71 %)[2]
Catégories libellées en EUR (non couvertes)		
Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 11 juin 2021)	18,14 %	20,40 %
Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (non couvert en EUR)	23,78 %	22,84 %
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 1er mars 2017)	9,66 %	4,83 %
Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (couvert en GBP)	14,96 %	4,09 %
Catégories libellées en GBP (non couvertes)		
Institutions en GBP (non couverte), distribution (lancement le 11 novembre 2022)	—	(5,01 %)
Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (non couvert en GBP)	—	(4,96 %)
Catégories libellées en SGD		
Catégorie E en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 17 décembre 2021)	9,59 %	12,59 %
Indice Bloomberg Commodity Index Total Return (couvert en SGD)	15,56 %	18,06 %

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» L'exposition aux matières premières au sens large a contribué à la performance absolue, car les matières premières au sens large, mesurées par l'Indice Bloomberg Commodity Index Total Return, ont dégagé une performance positive.

» L'allocation structurelle aux obligations mondiales à court terme indexées sur l'inflation en tant que nantissement garantissant l'exposition aux matières premières du Fonds a nui à la performance absolue, dans la mesure où ces obligations, telles que mesurées par l'Indice Bloomberg Barclays World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en USD), ont enregistré des pertes.

» La sous-pondération des taux d'intérêt souverains nominaux américains a contribué à la performance relative, les rendements nominaux américains ayant augmenté.

» La sous-pondération des taux d'intérêt souverains nominaux de la zone euro a contribué à la performance relative, les rendements souverains de la zone euro ayant augmenté.

» La surpondération des taux d'intérêt souverains nominaux britanniques a pesé sur la performance relative, les rendements nominaux britanniques ayant augmenté.

» L'exposition à des titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux a nui à la performance relative, puisque les écarts sur ces titres se sont creusés.

Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 14 octobre 2011)	(3,62 %)	2,76 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 21 décembre 2012)	(4,52 %)	1,14 %
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index[3]	1,78 %	0,97 %[2]
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 17 décembre 2012)	(6,14 %)	0,25 %
Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index[4]	(0,24 %)	(0,75 %)
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 14 octobre 2011)	(5,61 %)	1,47 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 21 décembre 2012)	(6,43 %)	(0,25 %)
Taux à court terme en euro (ESTER)[5]	(0,02 %)	(0,06 %)[2]

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

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

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

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

5 *La performance par rapport à l'indice de référence du Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice Euribor à 3 mois ; à partir du 1er juillet 2021 : Taux à court terme en euro (ESTER).*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» L'exposition à des titres financiers de qualité « investment grade » a contribué à la performance, un émetteur en particulier ayant surperformé.

» L'exposition à la duration a nui à la performance, les taux ayant augmenté.

» L'exposition aux marchés émergents a pesé sur la performance, certains promoteurs immobiliers chinois ayant sous-performé.

» L'exposition aux actifs titrisés a nui à la performance, certains titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles non émis par des organismes gouvernementaux ayant sous-performé.

Fonds Diversified Income Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2005)	(16,30 %)	5,01 %
Institutions, distribution (lancement le 8 septembre 2008)	(16,28 %)	4,98 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 30 avril 2013)	(16,64 %)	1,83 %
Investisseurs, distribution (lancement le 30 avril 2013)	(16,57 %)	1,83 %
Administrations, distribution (lancement le 21 juillet 2011)	(16,76 %)	2,90 %
BM Détail, distribution II (lancement le 28 avril 2022)	—	(6,15 %)
BN Détail, distribution II (lancement le 28 avril 2022)	—	(6,15 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 11 septembre 2006)	(17,04 %)	4,00 %
Catégorie E, distribution (lancement le 31 juillet 2006)	(17,04 %)	4,08 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 8 juin 2011)	(16,48 %)	3,23 %
H Institutions, distribution (lancement le 14 mai 2020)	(16,55 %)	(2,49 %)
M Détail, distribution (lancement le 30 novembre 2010)	(17,07 %)	2,78 %
M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013)	(17,06 %)	1,81 %
N Détail, distribution II (lancement le 30 octobre 2020)	(17,15 %)	(6,71 %)
Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014)	(17,38 %)	1,09 %
Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014)	(17,35 %)	1,09 %
Catégorie W, capitalisation (lancement le 12 août 2020)	(16,15 %)	(5,58 %)
Catégorie W, distribution (lancement le 12 août 2020)	(16,22 %)	(5,59 %)
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en USD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global (couvert en USD)[3]	(13,42 %)	4,81 %[2]
Catégories libellées en AUD		
Administrations en AUD (couverte), distribution (lancement le 22 mai 2019)	(17,80 %)	(2,55 %)
M Détail en AUD (couverte), distribution (lancement le 19 décembre 2012)	(18,19 %)	1,91 %
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en AUD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en AUD) et JPMorgan EMBI Global (couvert en AUD)[3]	(14,86 %)	2,86 %[2]
Catégories libellées en CAD		
Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 20 février 2019)	(16,60 %)	(0,65 %)
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en CAD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en CAD) et JPMorgan EMBI Global (couvert en CAD)[3]	(13,92 %)	(0,23 %)
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 24 juin 2011)	(18,61 %)	1,62 %
Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 31 août 2012)	(18,57 %)	0,83 %
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 11 septembre 2019)	(19,36 %)	(5,38 %)
Catégorie W en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)	(18,55 %)	(7,32 %)
Catégorie W en CHF (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)	(18,50 %)	(7,29 %)
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en CHF), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en CHF) et JPMorgan EMBI Global (couvert en CHF)[3]	(15,99 %)	1,73 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 14 février 2007)	(18,31 %)	3,75 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 17 octobre 2007)	(18,30 %)	3,75 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 5 juillet 2007)	(18,60 %)	3,53 %
Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 15 février 2013)	(18,58 %)	0,49 %
Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 20 juillet 2007)	(18,72 %)	3,38 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 3 juillet 2007)	(19,03 %)	3,00 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 16 octobre 2009)	(19,08 %)	2,35 %
Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)	(19,35 %)	(0,77 %)

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sélection de titres parmi les valeurs industrielles à haut rendement a contribué à la performance, en particulier l'exposition nulle à un émetteur du secteur de la santé, qui a sous-performé.

» La sélection de titres au sein des services aux collectivités de qualité « investment grade » a contribué à la performance, le secteur ayant connu un élargissement des écarts de crédit.

» L'exposition à certains promoteurs immobiliers chinois a nui à la performance, certains de ces émetteurs ayant sous-performé en raison de tensions continues en matière de liquidité.

» La sélection de titres parmi les titres financiers à haut rendement a pesé sur la performance, en particulier l'exposition à un émetteur européen de l'immobilier qui a sous-performé.

» Le positionnement sur les taux d'intérêt a nui à la performance, car la volatilité accrue a entraîné une plus grande dispersion de la performance entre les marchés des taux physiques et dérivés.

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1] (suite)

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégorie T en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 septembre 2014)	(19,31 %)	(0,77 %)
Catégorie W en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)	(18,21 %)	(7,05 %)
Catégorie W en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)	(18,29 %)	(7,07 %)
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en EUR), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en EUR) et JPMorgan EMBI Global (couvert en EUR)[3]	(15,66 %)	3,35 %[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 16 mai 2006)	(17,20 %)	4,68 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 14 février 2006)	(17,22 %)	4,62 %
Administrations en GBP (couverte), distribution (lancement le 21 juillet 2011)	(17,67 %)	2,22 %
Catégorie W en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)	(17,18 %)	(6,22 %)
Catégorie W en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)	(17,09 %)	(6,18 %)
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en GBP), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en GBP) et JPMorgan EMBI Global (couvert en GBP)[3]	(14,65 %)	4,30 %[2]
Catégories libellées en JPY		
Administrations en JPY (couverte), capitalisation (lancement le 8 octobre 2021)	(19,08 %)	(15,74 %)
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en JPY), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en JPY) et JPMorgan EMBI Global (couvert en JPY)[3]	(16,30 %)	(13,06 %)
Catégories libellées en MXN		
Institutions en MXN (couverte), capitalisation (lancement le 9 décembre 2020)	(10,71 %)	(2,79 %)
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en MXN), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en MXN) et JPMorgan EMBI Global (couvert en MXN)[3]	(7,65 %)	(0,77 %)
Catégories libellées en SEK		
Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	(17,96 %)	4,12 %
Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 30 décembre 2020)	(18,39 %)	(10,15 %)
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en SEK), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en SEK) et JPMorgan EMBI Global (couvert en SEK)[3]	(15,51 %)	3,72 %[2]
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 7 novembre 2019)	(16,57 %)	(3,04 %)
Administrations en SGD (couverte), distribution (lancement le 1er mai 2019)	(16,95 %)	(1,84 %)
Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 1er octobre 2019)	(17,32 %)	(3,84 %)
Catégorie W en SGD (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)	(16,40 %)	(5,63 %)
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en SGD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en SGD) et JPMorgan EMBI Global (couvert en SGD)[3]	(13,88 %)	(0,68 %)[2]

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

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

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

Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 mai 2011)	(4,13 %)	3,18 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 18 février 2014)	(4,47 %)	2,06 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 16 août 2013)	(5,03 %)	1,69 %
Catégorie E, distribution (lancement le 31 mai 2011)	(4,99 %)	2,29 %
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en USD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global (couvert en USD)[3]	(2,11 %)	2,97 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 16 août 2011)	(6,20 %)	2,13 %
Institutions en EUR (couverte), distribution II (lancement le 1er octobre 2013)	(6,09 %)	1,00 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 11 août 2011)	(6,96 %)	1,33 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 7 mai 2013)	(7,03 %)	(0,16 %)
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en EUR), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en EUR) et JPMorgan EMBI Global (couvert en EUR)[3]	(4,29 %)	2,09 %[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 23 août 2011)	(4,72 %)	2,96 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 22 janvier 2013)	(4,78 %)	1,65 %
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets (couvert en GBP), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en GBP) et JPMorgan EMBI Global (couvert en GBP)[3]	(2,98 %)	2,79 %[2]

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

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sélection de titres parmi les valeurs industrielles à haut rendement a contribué à la performance, en particulier l'exposition nulle à un émetteur du secteur de la santé, qui a sous-performé.

» La sélection de titres au sein des services aux collectivités de qualité « investment grade » a contribué à la performance, le secteur ayant connu un élargissement des écarts de crédit.

» L'exposition à certains promoteurs immobiliers chinois a nui à la performance, certains de ces émetteurs ayant sous-performé en raison de tensions continues en matière de liquidité.

» La sélections de titres parmi les actifs titrisés, en particulier l'exposition aux titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles non émis par des organismes gouvernementaux, a pesé sur la performance.

» La sélection de titres parmi les titres financiers à haut rendement a pesé sur la performance, en particulier l'exposition à un émetteur européen de l'immobilier qui a sous-performé.

Fonds Diversified Income ESG Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	—	(1,10 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	—	(1,50 %)
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets ; ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index et JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified.	—	(1,07 %)
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	—	(2,40 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	—	(2,80 %)
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (couvert en EUR) ; ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index (couvert en EUR) et JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified (couvert en EUR).	—	(2,51 %)
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	—	(1,70 %)
1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (couvert en GBP) ; ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index (couvert en GBP) et JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified (couvert en GBP).	—	(2,00 %)

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Le Fonds a commencé ses activités le 27 juillet 2022.

Aperçu du Fonds

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

» La sélection de titres parmi les valeurs industrielles à haut rendement a contribué à la performance, en particulier la surpondération d'un émetteur du secteur des médias, qui a surperformé.

» Les stratégies macro ont contribué à la performance en raison d'une sous-pondération de la duration des marchés développés.

» La sélection de titres parmi les valeurs financières de qualité « investment grade » a contribué à la performance, en particulier la surpondération de certains fournisseurs de services financiers et de certaines banques européennes qui ont surperformé.

» La sélection de titres au sein de la dette extérieure des marchés émergents a nui à la performance, notamment la sous-pondération de certains émetteurs d'Europe de l'Est qui ont surperformé.

» La sélection de titres dans le secteur de la santé à haut rendement a pesé sur la performance, en particulier la surpondération d'un prestataire de services de santé qui a sous-performé.

Fonds Dynamic Bond Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 15 décembre 2008)	(8,00 %)	2,20 %
Institutions, distribution (lancement le 22 février 2010)	(7,99 %)	1,82 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 24 septembre 2010)	(8,39 %)	1,12 %
Investisseurs, distribution (lancement le 24 septembre 2010)	(8,35 %)	1,11 %
Administrations, capitalisation (lancement le 21 janvier 2010)	(8,42 %)	1,30 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 11 mai 2010)	(8,86 %)	0,76 %
Catégorie E, distribution (lancement le 11 mai 2010)	(8,82 %)	0,78 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 12 décembre 2018)	(8,21 %)	0,42 %
H Institutions, distribution (lancement le 14 février 2020)	(8,23 %)	(1,22 %)
Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	(8,13 %)	1,01 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 15 septembre 2021)	(7,15 %)	(6,09 %)
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index[3]	1,69 %	0,71 %[2]
Catégories libellées en AUD		
Catégorie Z en AUD (couverte), distribution (lancement le 18 mars 2014)	(8,00 %)	2,64 %
Indice Bloomberg AusBond Bank Bills Index	1,25 %	1,52 %
Catégories libellées en CAD		
Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 21 septembre 2018)	(8,20 %)	0,19 %
Taux des mises en pension au jour le jour canadien (CORRA)[4]	1,83 %	0,99 %
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 8 septembre 2010)	(10,39 %)	(0,07 %)
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 avril 2011)	(11,22 %)	(1,03 %)
Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index[5]	(0,24 %)	(0,45 %)[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 21 mai 2009)	(9,95 %)	1,25 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 23 décembre 2009)	(9,99 %)	0,82 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 janvier 2011)	(10,24 %)	0,07 %
Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 21 janvier 2010)	(10,40 %)	0,25 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 20 novembre 2009)	(10,76 %)	(0,08 %)
G Détail en EUR (couverte), distribution (lancement le 14 décembre 2010)	(10,77 %)	(0,43 %)
Taux à court terme en euro (ESTER)[6]	(0,02 %)	0,01 %[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 15 décembre 2009)	(8,64 %)	1,45 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 27 février 2012)	(8,74 %)	1,03 %
Catégorie E en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 18 mars 2010)	(9,44 %)	0,42 %
Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index[7]	1,42 %	0,54 %[2]
Catégories libellées en NOK		
Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 11 avril 2011)	(8,63 %)	1,62 %
Taux NIBOR à 1 mois	1,59 %	1,28 %
Catégories libellées en SEK		
Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 18 novembre 2011)	(9,91 %)	0,23 %
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en SEK)[3]	0,45 %	0,21 %

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

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

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

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

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

6 *La performance par rapport à l'indice de référence du Fonds Dynamic Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice Euribor à 1 mois ; à partir du 1er juillet 2021 : Taux à court terme en euro (ESTER).*

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» L'exposition courte à la duration britannique a contribué à la performance, car les taux d'intérêt britanniques ont augmenté.

» L'exposition courte à l'euro a contribué à la performance, l'euro s'étant déprécié face au dollar américain.

» L'exposition longue au réal brésilien a contribué à la performance, cette devise s'étant apprécié face au dollar américain.

» L'exposition longue à la duration américaine a nui à la performance, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.

» L'exposition longue à la duration italienne a nui à la performance, les taux d'intérêt italiens ayant augmenté.

» Les participations dans le crédit d'entreprise de qualité « investment grade » ont nui à la performance, puisque les écarts sur ces titres se sont creusés.

Fonds Dynamic Multi-Asset Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en EUR		
Institutions, capitalisation (lancement le 25 février 2016)	(14,17 %)	2,61 %
Institutions, distribution II (lancement le 25 février 2016)	(14,12 %)	2,62 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 14 août 2020)	(14,42 %)	(2,91 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 25 février 2016)	(14,98 %)	1,56 %
Catégorie E, distribution (lancement le 10 septembre 2020)	(14,90 %)	(3,32 %)
Catégorie T, capitalisation (lancement le 20 octobre 2016)	(15,35 %)	0,42 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 1er août 2019)	(13,38 %)	2,14 %
Taux à court terme en euro (ESTER)[3]	(0,02 %)	(0,37 %)[2]
Catégories libellées en AUD		
BM Détail en AUD (couverte), distribution II (lancement le 28 avril 2022)	—	(6,88 %)
M Détail en AUD (couverte), distribution II (lancement le 8 avril 2021)	(14,25 %)	(8,24 %)
Indice Bloomberg AusBond Bank Bills Index	1,25 %	0,74 %[2]
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 14 mars 2018)	(14,59 %)	0,62 %
Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index[4]	(0,24 %)	(0,67 %)
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 25 février 2016)	(13,09 %)	3,44 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2019)	(13,06 %)	2,85 %
Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index[5]	1,42 %	0,53 %[2]
Catégories libellées en ILS		
Institutions en ILS (couverte), capitalisation (lancement le 27 septembre 2022)	—	(0,60 %)
Taux sans risque au jour le jour du Shekel SHIR	—	0,74 %
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 30 juillet 2021)	(12,40 %)	(8,89 %)
M Détail en SGD (couverte), distribution II (lancement le 18 décembre 2020)	(13,27 %)	(5,94 %)
Taux moyen interbancaire au jour le jour de Singapour SORA	1,57 %	0,86 %[2]
Catégories libellées en USD		
Institutions en USD (couverte), capitalisation (lancement le 25 février 2016)	(12,27 %)	4,66 %
Institutions en USD (couverte), distribution II (lancement le 30 avril 2021)	(12,28 %)	(6,83 %)
Investisseurs en USD (couverte), capitalisation (lancement le 11 mai 2021)	(12,62 %)	(6,66 %)
BM Détail en USD (couverte), distribution II (lancement le 28 avril 2022)	—	(6,09 %)
Catégorie E en USD (couverte), capitalisation (lancement le 15 mars 2017)	(13,18 %)	2,49 %
Catégorie E en USD (couverte), distribution (lancement le 18 mars 2021)	(13,16 %)	(6,66 %)
Catégorie E en USD (couverte), distribution II (lancement le 9 septembre 2021)	(13,11 %)	(11,21 %)
H Institutions en USD (couverte), capitalisation (lancement le 5 août 2020)	(12,44 %)	(1,81 %)
M Détail en USD (couverte), distribution II (lancement le 8 janvier 2020)	(13,16 %)	0,67 %
Catégorie T en USD (couverte), capitalisation (lancement le 9 septembre 2021)	(13,43 %)	(11,59 %)
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index[6]	1,69 %	1,20 %[2]

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

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

3 *La performance par rapport à l'indice de référence du Fonds Dynamic Multi-Asset Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice Euribor à 1 mois ; à partir du 1er juillet 2021 : Taux à court terme en euro (ESTER).*

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

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» L'exposition longue à la duration des États-Unis, de l'Australie et du Canada a nui aux rendements, car les rendements des bons du Trésor américains, australiens et canadiens ont augmenté.

» L'exposition longue aux actions chinoises a nui à la performance, car les cours ont chuté.

» L'exposition longue aux actions taïwanaises a nui à la performance, car les cours ont chuté.

» L'exposition longue aux devises des marchés émergents a contribué à la performance, car ces devises se sont appréciées face à l'euro.

» L'exposition courte à la duration de la zone euro au second semestre a contribué à la performance, car les rendements ont augmenté.

Fonds Emerging Local Bond Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 11 décembre 2007)	(6,58 %)	1,56 %
Institutions, distribution (lancement le 18 avril 2008)	(6,52 %)	1,34 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 18 août 2010)	(6,84 %)	(0,39 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 19 novembre 2008)	(7,49 %)	2,32 %
Catégorie E, distribution (lancement le 8 juillet 2010)	(7,40 %)	(0,66 %)
H Institutions, capitalisation (lancement le 26 février 2021)	(6,61 %)	(6,12 %)
Catégorie Z, distribution (lancement le 18 novembre 2008)	(5,74 %)	4,18 %
Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert)	(11,69 %)	1,41 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 16 avril 2010)	(0,46 %)	2,12 %
Institutions en EUR (non couverte), distribution (lancement le 23 juin 2010)	(0,47 %)	1,54 %
Investisseurs en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 20 décembre 2019)	(0,75 %)	(2,47 %)
Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 2 juillet 2009)	(1,39 %)	2,63 %
Catégorie E en EUR (non couverte), distribution (lancement le 12 décembre 2018)	(1,46 %)	1,56 %
Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en EUR)	(5,90 %)	3,44 %[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (non couverte), capitalisation (lancement le 27 juin 2008)	5,23 %	5,16 %
Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en GBP)	(0,56 %)	4,96 %

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» Le positionnement sur la duration locale russe a contribué à la performance, les rendements locaux russes ayant augmenté lorsque le Fonds avait une exposition sous-pondérée et diminué lorsque celui-ci était légèrement surpondéré.

» La sous-pondération de la duration locale polonaise a contribué à la performance, les rendements locaux polonais ayant augmenté.

» La sous-pondération de la livre égyptienne a contribué à la performance, la devise égyptienne s'étant affaiblie.

» La surpondération de la duration locale brésilienne a pesé sur la performance, les rendements locaux brésiliens ayant augmenté.

» La sous-pondération de la duration locale turque a nui à la performance, les rendements locaux turcs ayant chuté.

Fonds Emerging Local Bond ESG Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	—	5,70 %
Institutions, distribution (lancement le 27 juillet 2022)	—	5,71 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	—	5,60 %
Investisseurs, distribution (lancement le 27 juillet 2022)	—	5,55 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	—	5,30 %
Catégorie E, distribution (lancement le 27 juillet 2022)	—	5,26 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 23 septembre 2022)	—	7,70 %
Indice JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index	—	5,62 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	—	0,20 %
Institutions en EUR (non couverte), distribution (lancement le 27 juillet 2022)	—	0,28 %
Investisseurs en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	—	0,10 %
Investisseurs en EUR (non couverte), distribution (lancement le 27 juillet 2022)	—	0,13 %
Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	—	(0,20 %)
Catégorie E en EUR (non couverte), distribution (lancement le 27 juillet 2022)	—	(0,25 %)
Indice JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en EUR)	—	0,16 %

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Le Fonds a commencé ses activités le 27 juillet 2022.

Aperçu du Fonds

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

» La sous-pondération de la livre égyptienne a contribué à la performance, cette devise s'étant affaiblie.

» La surpondération du ringgit malaisien a contribué à la performance, cette devise s'étant raffermie.

» La surpondération du dollar taïwanais a contribué à la performance, cette devise s'étant raffermie.

» La sous-pondération de la duration locale turque a nui à la performance, les rendements locaux turcs ayant chuté.

» La sous-pondération du zloty polonais a nui à la performance, cette devise s'étant raffermie.

Fonds Emerging Markets Bond Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 juillet 2001)	(17,05 %)	7,29 %
Institutions, distribution (lancement le 13 décembre 2001)	(17,06 %)	6,66 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 25 avril 2002)	(17,33 %)	5,92 %
Administrations, capitalisation (lancement le 29 mai 2003)	(17,46 %)	4,83 %
BM Détail, distribution II (lancement le 28 avril 2022)	—	(5,91 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	(17,80 %)	3,50 %
Catégorie E, distribution (lancement le 28 octobre 2005)	(17,80 %)	3,66 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 17 octobre 2002)	(17,18 %)	6,81 %
H Institutions, distribution (lancement le 3 septembre 2020)	(17,21 %)	(7,42 %)
M Détail, distribution (lancement le 30 novembre 2010)	(17,84 %)	2,05 %
M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013)	(17,78 %)	1,15 %
Catégorie Z, distribution (lancement le 18 novembre 2008)	(16,39 %)	6,76 %
Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	(16,45 %)	6,56 %[2]
Catégories libellées en AUD		
M Détail en AUD (couverte), distribution (lancement le 19 décembre 2012)	(18,86 %)	0,62 %
Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en AUD)	(18,03 %)	1,54 %
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 16 décembre 2005)	(19,33 %)	2,54 %
Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en CHF)	(19,03 %)	2,75 %
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 17 décembre 2002)	(19,05 %)	5,27 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 20 décembre 2010)	(19,06 %)	1,69 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 20 décembre 2019)	(19,29 %)	(6,49 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	(19,78 %)	2,23 %
Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en EUR)	(18,80 %)	5,18 %[2]
Catégories libellées en EUR (non couvertes)		
Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 9 février 2018)	(11,63 %)	2,44 %
Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (non couvert en EUR)	(10,98 %)	2,37 %
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 5 février 2004)	(17,97 %)	4,92 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)	(18,01 %)	3,89 %
Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en GBP)	(17,79 %)	5,16 %[2]
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 2 juillet 2018)	(17,32 %)	(0,27 %)
Catégorie E en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 15 février 2007)	(18,03 %)	2,60 %
Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global (couvert en SGD)	(17,01 %)	3,90 %[2]

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sous-pondération de la dette russe a contribué à la performance, les écarts s'étant creusés.

» La sous-pondération des taux d'intérêt américains a contribué à la performance, les rendements américains ayant augmenté.

» La surpondération de la dette ukrainienne a nui à la performance, les écarts ukrainiens s'étant creusés.

» La sous-pondération des écarts des marchés émergents a pesé sur la performance, les écarts s'étant resserrés au quatrième trimestre.

» La surpondération de la dette souveraine ghanéenne a nui à la performance, les écarts ghanéens s'étant creusés.

Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 16 avril 2010)	(19,57 %)	2,76 %
Institutions, distribution (lancement le 10 juillet 2019)	(19,56 %)	(3,99 %)
Administrations, capitalisation (lancement le 10 juillet 2019)	(20,06 %)	(4,47 %)
Administrations, distribution (lancement le 10 juillet 2019)	(20,06 %)	(4,48 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 5 février 2021)	(20,35 %)	(12,78 %)
Catégorie E, distribution (lancement le 5 février 2021)	(20,28 %)	(12,78 %)
Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified[3]	(18,92 %)	3,28 %[2]
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 9 avril 2021)	(21,78 %)	(13,19 %)
Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (couvert en CHF)[3]	(21,46 %)	(12,61 %)
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 16 octobre 2013)	(21,61 %)	(0,31 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2017)	(21,62 %)	(3,64 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 août 2018)	(22,27 %)	(3,73 %)
Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (couvert en EUR)[3]	(21,25 %)	0,27 %[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 décembre 2019)	(20,55 %)	(6,22 %)
Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (couvert en GBP)[3]	(20,28 %)	(6,38 %)
Catégories libellées en GBP (non couvertes)		
Institutions en GBP (non couverte), distribution (lancement le 11 décembre 2020)	(9,45 %)	(6,71 %)
Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (non couvert en GBP)[3]	(8,71 %)	(6,15 %)
Catégories libellées en NOK		
Investisseurs en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 17 mars 2014)	(20,97 %)	0,45 %
Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (couvert en NOK)[3]	(20,61 %)	1,06 %
Catégories libellées en SEK		
Investisseurs en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 6 février 2014)	(21,47 %)	(0,57 %)
Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 8 octobre 2021)	(21,61 %)	(18,60 %)
Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified (couvert en SEK)[3]	(21,18 %)	0,27 %[2]

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

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sous-pondération de la dette russe a contribué à la performance, les écarts russes s'étant creusés.

» La sous-pondération des taux d'intérêt américains a contribué à la performance, les rendements américains ayant augmenté.

» La surpondération de la dette ukrainienne a nui à la performance, les écarts ukrainiens s'étant creusés.

» La sélection de titres parmi les entreprises chinoises a pesé sur la performance, certains titres immobiliers ayant subi des baisses de prix.

» L'exposition nulle à l'Arabie saoudite a nui à la performance, les écarts saoudiens s'étant resserrés.

Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 12 novembre 2009)	(13,42 %)	3,38 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 27 février 2012)	(14,22 %)	1,46 %
Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	(12,92 %)	4,62 %[2]
Catégories libellées en CHF		
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 25 mai 2012)	(16,29 %)	(0,33 %)
Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (couvert en CHF)	(15,37 %)	1,73 %
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 19 février 2010)	(15,30 %)	2,03 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 mars 2010)	(16,10 %)	1,00 %
Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Diversified Index (couvert en EUR)	(15,07 %)	3,20 %[2]

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sous-pondération des taux d'intérêt américains a contribué à la performance, les rendements américains ayant augmenté.

» La surpondération des titres d'entreprises brésiliennes a contribué à la performance, ces titres ayant surperformé l'indice.

» La sélection de titres parmi les entreprises chinoises a pesé sur la performance, certains titres immobiliers chinois ayant subi des baisses de prix.

» La surpondération des titres d'entreprises russes a nui à la performance, ces titres ayant sous-performé l'indice.

» La sélection de titres parmi les entreprises ukrainiennes a pesé sur la performance, certains titres ukrainiens ayant subi des baisses de prix.

Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 4 juin 2019)	(7,66 %)	0,67 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 8 juin 2022)	—	0,20 %
50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index / 50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en USD)	(14,07 %)	(2,44 %)[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 4 juin 2019)	(9,24 %)	(0,76 %)
Catégorie E en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 19 avril 2022)	—	(6,50 %)
50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index (couvert en EUR) / 50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en EUR)	(12,47 %)	(2,70 %)[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (partiellement couverte), distribution (lancement le 29 mars 2022)	—	(4,37 %)
50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index (couvert en GBP) / 50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en GBP)	—	(3,09 %)

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sous-pondération de la duration américaine a contribué à la performance, les rendements américains ayant augmenté.

» Le positionnement sur la duration locale russe a contribué à la performance, les rendements locaux russes ayant augmenté lorsque le Fonds avait une exposition sous-pondérée et diminué lorsque celui-ci était légèrement surpondéré.

» La sous-pondération de la duration locale polonaise a contribué à la performance, les rendements polonais ayant augmenté.

» La sous-pondération du peso mexicain a nui à la performance, cette devise s'étant raffermie.

» La surpondération de la dette d'entreprises chinoises a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Catégorie E, capitalisation (lancement le 19 novembre 2008)	(5,05 %)	1,03 %
Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert)	(7,14 %)	0,96 %
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 20 janvier 2010)	2,03 %	2,68 %
Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 2 juillet 2009)	1,21 %	2,17 %
Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en EUR)	(1,05 %)	2,80 %[2]

[1] *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
[2] *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» L'exposition nulle à la duration locale russe a contribué à la performance, les rendements locaux russes ayant augmenté.

» La sous-pondération de la duration locale polonaise a contribué à la performance, les rendements locaux polonais ayant augmenté.

» La sous-pondération de la livre égyptienne a contribué à la performance, la devise égyptienne s'étant affaiblie.

» La surpondération du peso chilien a nui à la performance, cette devise s'étant affaiblie.

» La surpondération du peso colombien a pesé sur la performance, cette devise s'étant affaiblie.

Fonds PIMCO ESG Income Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 29 avril 2021)	(6,73 %)	(3,51 %)
Institutions, distribution (lancement le 29 avril 2021)	(6,77 %)	(3,53 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 29 avril 2021)	(7,57 %)	(4,37 %)
Catégorie E, distribution (lancement le 29 avril 2021)	(7,51 %)	(4,38 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index	(13,01 %)	(7,35 %)
Catégories libellées en AUD		
Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 19 novembre 2021)	(7,67 %)	(6,68 %)
Catégorie R en AUD (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021)	(7,90 %)	(4,37 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en AUD)	(14,24 %)	(8,20 %)[2]
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 29 avril 2021)	(9,17 %)	(5,42 %)
Catégorie E en CHF (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021)	(9,93 %)	(6,22 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CHF)	(15,62 %)	(9,42 %)
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 29 avril 2021)	(8,67 %)	(5,04 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 21 mai 2021)	(8,67 %)	(5,29 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 juin 2021)	(9,56 %)	(6,77 %)
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021)	(9,48 %)	(5,89 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en EUR)	(15,19 %)	(9,06 %)[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021)	(7,41 %)	(4,15 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en GBP)	(14,06 %)	(8,09 %)
Catégories libellées en SEK		
Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 29 octobre 2021)	(8,24 %)	(7,08 %)
Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 12 mai 2022)	—	(2,77 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SEK)	(14,88 %)	(12,94 %)[2]
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2021)	(6,87 %)	(3,59 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SGD)	(13,32 %)	(7,50 %)

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» L'exposition courte à la duration britannique a contribué à la performance, car les taux d'intérêt britanniques ont augmenté.

» L'exposition courte à la duration japonaise a contribué à la performance, les rendements japonais ayant augmenté.

» L'exposition longue à la duration américaine a nui à la performance, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.

» L'exposition longue au crédit d'entreprises de qualité « investment grade » et à haut rendement a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

» Les positions sur le crédit titrisé, notamment des titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux ou non émis par des organismes gouvernementaux, et des titres adossés à des créances hypothécaires commerciales, ont nui à la performance.

Fonds Euro Bond Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en EUR		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 décembre 1998)	(17,41 %)	3,26 %
Institutions, distribution (lancement le 7 janvier 2003)	(17,38 %)	2,89 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 8 mai 2002)	(17,70 %)	2,83 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	(18,18 %)	1,50 %
Catégorie E, distribution (lancement le 10 octobre 2005)	(18,16 %)	1,29 %
Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	(17,17 %)	3,06 %[2]
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2006)	(17,91 %)	1,66 %
Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Index (couvert en CHF)	(17,60 %)	1,70 %

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sous-pondération de la duration du bloc euro a contribué à la performance relative, les taux d'intérêt du bloc euro ayant augmenté.

» L'exposition courte à la duration américaine a contribué à la performance relative, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.

» L'exposition longue aux points morts français et italiens a contribué à la performance relative, les prévisions d'inflation ayant été revues à la hausse.

» L'exposition longue au crédit titrisé, principalement sous la forme de titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles (« RMBS ») non émis par des organismes gouvernementaux et de prêts garantis (« CLO ») européens de qualité supérieure, a nui à la performance relative, les écarts s'étant creusés.

» L'exposition courte aux points morts britanniques a nui à la performance relative, les prévisions d'inflation ayant été revues à la hausse.

» La surpondération des titres d'entreprises financières, tant par le biais de la dette senior que du capital bancaire, a nui à la performance relative, les écarts s'étant creusés.

Fonds Euro Credit Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en EUR		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 janvier 2008)	(16,69 %)	2,39 %
Institutions, distribution II (lancement le 1er octobre 2013)	(16,69 %)	0,73 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 25 mai 2010)	(17,43 %)	0,89 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 7 juin 2019)	(16,62 %)	(4,20 %)
H Institutions, distribution II (lancement le 7 juin 2019)	(16,60 %)	(4,21 %)
Indice Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index	(15,56 %)	2,29 %[2]

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» Les stratégies macro, en particulier la sous-pondération de la duration européenne, ont contribué à la performance, car les taux ont augmenté.

» La sous-pondération du secteur public, qui a sous-performé au cours de l'année, a contribué à la performance.

» La surpondération et la sélection de titres au sein des sociétés d'investissement immobilier ont nui à la performance, le secteur ayant sous-performé le marché dans son ensemble sur fond d'inquiétudes quant à l'impact de la hausse des taux.

» La sélection de titres dans le secteur bancaire a nui à la performance, car un émetteur surpondéré a sous-performé en raison de l'annonce d'un plan de restructuration.

» La sélection de titres au sein de la dette extérieure des marchés émergents a nui à la performance, car l'exposition à la dette russe a sous-performé suite à l'annonce de sanctions.

Fonds Euro Income Bond Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en EUR		
Institutions, capitalisation (lancement le 28 février 2011)	(12,03 %)	2,81 %
Institutions, distribution (lancement le 28 février 2011)	(11,94 %)	2,83 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 13 décembre 2019)	(12,38 %)	(3,68 %)
Investisseurs, distribution (lancement le 29 mai 2012)	(12,26 %)	2,39 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 28 février 2011)	(12,78 %)	1,90 %
Catégorie E, distribution (lancement le 28 février 2011)	(12,77 %)	1,89 %
Catégorie T, capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)	(13,19 %)	(0,48 %)
Catégorie T, distribution (lancement le 30 septembre 2014)	(13,13 %)	(0,48 %)
Indice Bloomberg Euro Aggregate 1-10 Year Bond Index	(12,06 %)	1,46 %[2]

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» L'exposition courte à la duration japonaise a contribué à la performance, les rendements ayant augmenté.

» L'exposition courte modeste à la duration britannique a contribué à la performance, car les taux d'intérêt ont augmenté.

» L'exposition longue au peso mexicain a contribué à la performance, cette devise s'étant appréciée face au dollar américain.

» Les participations dans la dette extérieure des marchés émergents ont nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

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

» L'exposition longue au crédit d'entreprise à haut rendement a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

Fonds Euro Long Average Duration Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en EUR		
Institutions, capitalisation (lancement le 21 avril 2006)	(35,71 %)	3,93 %
Indice Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index[2]	(36,21 %)	2,87 %

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sous-pondération de la duration des pays principaux de la zone euro a contribué à la performance relative, les rendements ayant augmenté dans la zone euro.

» La sous-pondération de la duration nominale américaine a contribué à la performance relative, les rendements nominaux ayant augmenté.

» La surpondération des actifs titrisés, en particulier des titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles européennes, a nui à la performance relative, les écarts s'étant creusés.

» La surpondération du point mort d'inflation américain a nui à la performance relative, les prévisions d'inflation ayant été revues à la baisse.

Fonds Euro Short-Term Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en EUR		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 janvier 2006)	(1,17 %)	0,99 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	(1,98 %)	0,23 %
Taux à court terme en euro (ESTER)[3]	(0,02 %)	0,70 %[2]

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*
3 *La performance par rapport à l'indice de référence du Fonds Euro Short-Term Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice Euribor à 1 mois ; à partir du 1er juillet 2021 : Taux à court terme en euro (ESTER).*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» L'exposition courte à la duration de la zone euro au premier semestre a contribué à la performance, les taux d'intérêt ayant augmenté.

» L'exposition au taux de base européen positif a contribué à la performance.

» L'exposition longue à la duration britannique a nui à la performance, les taux d'intérêt ayant augmenté.

» L'exposition longue au crédit d'entreprise de qualité « investment grade » a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

» L'exposition longue à la dette extérieure des marchés émergents a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en EUR		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 janvier 2020)	(9,82 %)	(0,93 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 22 décembre 2022)	—	0,00 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 31 janvier 2020)	(9,36 %)	(0,41 %)
Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	(11,36 %)	(2,43 %)[2]

[1] *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
[2] *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sélection de titres dans le secteur de l'énergie a contribué à la performance, de par l'exposition nulle à un émetteur qui a sous-performé.

» La surpondération et la sélection de titres dans le secteur de la santé ont contribué à la performance, le secteur ainsi qu'un émetteur surpondéré ayant surperformé.

» La sélection de titres dans le secteur des biens de consommation non cycliques a contribué à la performance, un émetteur surpondéré ayant surperformé.

» La sélection de titres dans les secteurs des produits forestiers, du papier et des emballages a nui à la performance, certains émetteurs surpondérés ayant sous-performé.

» La sélection de titres dans le secteur des transports a nui à la performance, un émetteur surpondéré ayant sous-performé.

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en EUR		
Institutions, capitalisation (lancement le 5 juillet 2011)	(3,08 %)	0,83 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 25 mars 2013)	(3,58 %)	(0,61 %)
H Institutions, capitalisation (lancement le 8 janvier 2020)	(3,24 %)	(1,53 %)
Taux à court terme en euro (ESTER)[3]	(0,01 %)	0,98 %[2]

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

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» L'exposition courte à la duration américaine a contribué à la performance, les taux d'intérêt ayant augmenté.

» L'exposition longue aux obligations couvertes danoises a contribué à la performance, grâce à la sélection de titres.

» L'exposition courte aux pays de la périphérie de l'Europe au second semestre de l'année, plus précisément à l'Italie, a contribué à la performance, les écarts des bund BTP s'étant creusés.

» L'exposition longue au crédit d'entreprise de qualité « investment grade » a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

» L'exposition longue au crédit d'entreprise à haut rendement a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

Fonds Global Advantage Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 9 juin 2009)	(13,32 %)	2,11 %
Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (clôture de la Bourse de Londres)	(14,10 %)	1,60 %
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (partiellement couverte), distribution (lancement le 2 août 2011)	(11,40 %)	1,12 %
Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (partiellement couvert en CHF) (clôture de la Bourse de Londres)	(12,26 %)	0,60 %
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 24 mai 2010)	(9,82 %)	2,02 %
Catégorie E en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 6 mai 2010)	(10,76 %)	1,01 %
Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (partiellement couvert en EUR) (clôture de la Bourse de Londres)	(10,79 %)	1,57 %[2]
Catégories libellées en NOK		
Institutions en NOK (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 5 mars 2012)	(7,83 %)	3,22 %
Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (partiellement couvert en NOK) (clôture de la Bourse de Londres)	(8,72 %)	2,75 %

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sous-pondération de la duration américaine a contribué à la performance, les taux d'intérêt ayant augmenté.

» La sous-pondération de la duration britannique a contribué à la performance, les taux d'intérêt ayant augmenté.

» L'exposition nulle à la duration locale russe au premier trimestre a contribué à la performance, les taux d'intérêt ayant augmenté.

» Le positionnement au sein des taux du bloc euro a nui à la performance, car les taux ont augmenté sur toute la courbe et les écarts des swaps européens se sont creusés.

» L'exposition longue au crédit titrisé, principalement sous la forme de titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux aux États-Unis et de prêts garantis, a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

» La surpondération des valeurs financières a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

Fonds Global Bond Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 12 mars 1998)	(11,39 %)	4,76 %
Institutions, distribution (lancement le 18 avril 2001)	(11,34 %)	4,40 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 1er mars 1999)	(11,69 %)	4,23 %
Investisseurs, distribution (lancement le 23 janvier 2001)	(11,71 %)	4,05 %
Administrations, capitalisation (lancement le 14 juin 2004)	(11,82 %)	3,69 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	(12,18 %)	3,15 %
Catégorie E, distribution (lancement le 28 octobre 2005)	(12,21 %)	3,12 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 15 octobre 2002)	(11,55 %)	4,06 %
H Institutions, distribution (lancement le 14 février 2020)	(11,48 %)	(2,88 %)
M Détail, distribution II (lancement le 26 avril 2017)	(12,18 %)	0,13 %
Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014)	(12,44 %)	0,75 %
Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014)	(12,44 %)	0,75 %
Catégorie W, capitalisation (lancement le 12 août 2020)	(11,28 %)	(4,45 %)
Catégorie W, distribution (lancement le 12 août 2020)	(11,27 %)	(4,47 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD)[3]	(11,22 %)	4,02 %[2]
Catégories libellées en USD (exposition au risque de change)		
Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 13 décembre 2002)	(16,09 %)	3,66 %
Institutions (exposition au risque de change), distribution (lancement le 23 mars 2006)	(16,10 %)	3,20 %
Catégorie E (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 19 mai 2010)	(16,87 %)	1,17 %
Catégorie E (exposition au risque de change), distribution (lancement le 19 mai 2010)	(16,84 %)	1,17 %
H Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 26 février 2021)	(16,21 %)	(10,38 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en USD)[3]	(16,25 %)	2,82 %[2]
Catégories libellées en CAD		
Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 21 septembre 2018)	(11,55 %)	0,26 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en CAD)[3]	(11,53 %)	0,06 %
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 8 mai 2003)	(13,64 %)	2,26 %
Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 10 avril 2003)	(13,61 %)	2,30 %
Investisseurs en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 28 juin 2011)	(13,89 %)	1,24 %
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 13 juin 2018)	(14,41 %)	(2,50 %)
Catégorie W en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)	(13,57 %)	(6,12 %)
Catégorie W en CHF (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)	(13,57 %)	(6,11 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en CHF)[3]	(13,71 %)	1,45 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 4 avril 2003)	(13,25 %)	3,21 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 avril 2005)	(13,24 %)	3,04 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 février 2005)	(13,52 %)	2,69 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	(13,98 %)	2,23 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2016)	(13,98 %)	(1,11 %)
G Détail en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 décembre 2012)	(14,04 %)	(0,10 %)
Catégorie R en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	(13,45 %)	0,53 %
Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)	(14,22 %)	(0,89 %)
Catégorie W en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)	(13,13 %)	(5,81 %)
Catégorie W en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)	(13,08 %)	(5,77 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en EUR)[3]	(13,27 %)	2,34 %[2]
Catégories libellées en EUR (exposition au risque de change)		
Institutions en EUR (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 20 février 2013)	(10,64 %)	2,58 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en EUR)[3]	(10,76 %)	2,06 %

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sous-pondération de la duration américaine a contribué à la performance relative, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.

» La sous-pondération de la duration britannique a contribué à la performance relative, les taux d'intérêt britanniques ayant augmenté.

» La sous-pondération de la duration japonaise a contribué à la performance relative, les taux d'intérêt japonais ayant augmenté.

» Le positionnement au sein des taux du bloc euro a nui à la performance relative, les taux d'intérêt ayant augmenté sur toute la courbe et les écarts des swaps européens se sont élargis.

» La surpondération des titres d'entreprises financières a nui à la performance relative, les écarts s'étant creusés.

» L'exposition longue au crédit titrisé, principalement sous la forme de titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles (RMBS) non émis par des organismes gouvernementaux aux États-Unis et de RMBS du Royaume-Uni ont pesé sur la performance relative, les écarts s'étant creusés.

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1] (suite)

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 16 avril 2003)	(12,05 %)	4,18 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 1er juin 2004)	(12,01 %)	4,18 %
Investisseurs en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 14 avril 2005)	(12,36 %)	3,53 %
Catégorie W en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)	(12,00 %)	(4,90 %)
Catégorie W en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)	(12,00 %)	(4,92 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en GBP)[3]	(12,15 %)	3,37 %[2]
Catégories libellées en GBP (exposition au risque de change)		
Institutions en GBP (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 9 mars 2018)	(5,58 %)	1,36 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en GBP)[3]	(5,70 %)	1,11 %
Catégories libellées en HKD		
M Détail en HKD (non couverte), distribution II (lancement le 26 avril 2017)	(12,07 %)	0,17 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en HKD)[3]	(11,12 %)	0,73 %
Catégories libellées en NOK		
Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2005)	(12,16 %)	4,19 %
Investisseurs en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 26 juillet 2006)	(12,47 %)	4,16 %
Catégorie W en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 13 avril 2021)	(12,06 %)	(6,99 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en NOK)[3]	(12,16 %)	3,31 %[2]
Catégories libellées en NZD		
Institutions en NZD (couverte), distribution (lancement le 1er novembre 2004)	(11,68 %)	6,10 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en NZD)[3]	(11,75 %)	5,19 %
Catégories libellées en SEK		
Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 8 novembre 2004)	(12,81 %)	3,36 %
Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 2 juillet 2021)	(13,25 %)	(9,56 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en SEK)[3]	(12,96 %)	2,42 %[2]
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 7 août 2009)	(11,51 %)	4,10 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en SGD)[3]	(11,45 %)	2,61 %

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

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

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

Fonds Global Bond ESG Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 12 janvier 2017)	(11,75 %)	0,97 %
Institutions, distribution (lancement le 3 avril 2020)	(11,68 %)	(2,27 %)
Investisseurs, capitalisation (lancement le 7 novembre 2018)	(12,10 %)	0,24 %
Catégorie E, distribution (lancement le 8 mars 2019)	(12,50 %)	(1,03 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD)	(11,22 %)	0,78 %[2]
Catégories libellées en AUD		
Catégorie Z en AUD (couverte), distribution (lancement le 12 janvier 2017)	(12,14 %)	1,10 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en AUD)	(12,28 %)	0,39 %
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 12 janvier 2017)	(13,96 %)	(1,42 %)
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 1er septembre 2022)	—	(3,40 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en CHF)	(13,71 %)	(1,65 %)[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 janvier 2017)	(13,52 %)	(1,03 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 janvier 2017)	(13,57 %)	(1,04 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 9 février 2017)	(14,40 %)	(1,92 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en EUR)	(13,27 %)	(1,24 %)[2]
Catégories libellées en EUR (exposition au risque de change)		
Institutions en EUR (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 29 novembre 2021)	(11,14 %)	(10,62 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en EUR)	(10,76 %)	(10,64 %)
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 3 juin 2020)	(12,42 %)	(3,88 %)
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 janvier 2017)	(12,44 %)	(0,07 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en GBP)	(12,15 %)	(0,25 %)[2]
Catégories libellées en GBP (exposition au risque de change)		
Institutions en GBP (exposition au risque de change), distribution (lancement le 4 août 2022)	—	(3,99 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en GBP)	—	(4,24 %)
Catégories libellées en GBP (non couvertes)		
Institutions en GBP (non couverte), distribution (lancement le 11 décembre 2020)	(0,56 %)	(1,97 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (non couvert en GBP)	(0,03 %)	(1,23 %)
Catégories libellées en NOK		
Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 12 janvier 2017)	(12,47 %)	0,18 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en NOK)	(12,16 %)	0,05 %
Catégories libellées en NZD		
Institutions en NZD (couverte), distribution (lancement le 5 avril 2017)	(12,05 %)	0,69 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en NZD)	(11,75 %)	0,61 %
Catégories libellées en SEK		
Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 20 mai 2021)	(13,16 %)	(8,27 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en SEK)	(12,96 %)	(7,82 %)

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sous-pondération de la duration américaine a contribué à la performance, la courbe des taux d'intérêt s'étant redressée.

» La sous-pondération de la duration britannique a contribué à la performance, les taux d'intérêt ayant augmenté.

» La sous-pondération de la duration japonaise a contribué à la performance, les taux d'intérêt ayant augmenté vers la fin de l'année.

» Le positionnement au sein des taux du bloc euro a nui à la performance, car les taux ont augmenté sur toute la courbe et les écarts des swaps européens se sont creusés.

» La surpondération des valeurs financières, tant senior que via le capital bancaire, a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

» L'exposition longue au crédit titrisé, principalement via les titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux aux États-Unis et les prêts garantis de haute qualité en Europe, a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

Fonds Global Bond Ex-US Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 mars 2003)	(9,98 %)	4,16 %
Institutions, distribution (lancement le 9 novembre 2005)	(10,00 %)	4,19 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 28 février 2006)	(10,30 %)	3,77 %
Administrations, capitalisation (lancement le 14 septembre 2004)	(10,44 %)	3,78 %
Catégorie E, distribution (lancement le 30 avril 2008)	(10,81 %)	3,27 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 12 décembre 2018)	(10,18 %)	0,15 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 30 octobre 2019)	(9,56 %)	(1,41 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en USD)[3]	(9,76 %)	3,24 %[2]
Catégories libellées en USD (exposition au risque de change)		
Catégorie E (exposition au risque de change), distribution (lancement le 4 octobre 2016)	(19,11 %)	(2,71 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (non couvert en USD)[3]	(18,70 %)	(2,42 %)
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 4 avril 2006)	(11,75 %)	3,41 %
Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en EUR)[3]	(11,70 %)	2,28 %

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*
3 *La performance de l'indice de référence du Fonds Global Bond Ex-US Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 19 janvier 2016 : Indice FTSE World Government Bond ex-U.S. Index (couvert en USD) ; à partir du 20 janvier 2016 : Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en USD).*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sous-pondération de la duration américaine a contribué à la performance, les taux d'intérêt ayant augmenté.

» La sous-pondération de la duration britannique a contribué à la performance, les taux d'intérêt ayant augmenté.

» La sous-pondération de la duration japonaise a contribué à la performance, les taux d'intérêt ayant augmenté.

» Le positionnement au sein des taux du bloc euro a nui à la performance, car les taux ont augmenté sur toute la courbe et les écarts des swaps européens se sont creusés.

» L'exposition longue aux actifs titrisés, principalement les prêts garantis européens et les titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux aux États-Unis, a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

» La surpondération des valeurs financières a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 15 avril 2009)	(17,06 %)	5,08 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 24 septembre 2010)	(17,34 %)	3,15 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 22 juin 2009)	(18,01 %)	3,59 %
Catégorie E, distribution (lancement le 28 janvier 2011)	(18,06 %)	2,03 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 29 avril 2022)	—	(5,70 %)
H Institutions, distribution (lancement le 29 avril 2022)	—	(5,68 %)
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 6 juillet 2016)	(16,27 %)	6,14 %
60 % de l'Indice MSCI All Country World Index / 40 % de l'Indice Bloomberg Global Aggregate (couvert en USD)	(15,32 %)	7,26 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 15 avril 2009)	(17,55 %)	4,22 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 22 juin 2009)	(18,53 %)	2,73 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 24 juin 2011)	(18,61 %)	1,02 %
60 % de l'Indice MSCI All Country World Index couvert en EUR / 40 % de l'Indice Bloomberg Global Aggregate (couvert en EUR)	(15,91 %)	6,20 %[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 7 avril 2010)	(16,55 %)	3,38 %
60 % de l'Indice MSCI All Country World Index couvert en GBP / 40 % de l'Indice Bloomberg Global Aggregate (couvert en GBP)	(14,99 %)	5,46 %

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La position sur la duration américaine, notamment la sous-pondération de la partie intermédiaire de la courbe des taux, a contribué à la performance relative, cette partie de la courbe ayant augmenté.

» Les stratégies de valeur relative sur les sociétés d'investissement immobilier (REIT) ont contribué à la performance relative, l'exposition longue à certains titres individuels ayant surperformé l'exposition courte à l'indice au sens large.

» La position sur la duration des marchés émergents, en particulier la sous-pondération de la duration hongroise, a contribué à la performance relative, la courbe ayant augmenté au cours de l'année.

» La position sur les actions américaines a nui à la performance relative, étant donné que nous avons été surpondérés pendant la première partie de l'année et sous-pondérés pendant les derniers mois de l'année par rapport à l'indice de référence.

» La position sur la duration de la zone euro, notamment la surpondération de la partie longue de la courbe des taux, a nui à la performance, cette partie de la courbe ayant augmenté.

» La position sur certains crédits titrisés, en particulier la sélection de titres dans les titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles (RMBS), a nui à la performance relative sur la période, ces titres ayant affiché des rendements négatifs.

Fonds Global High Yield Bond Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2005)	(10,28 %)	5,59 %
Institutions, distribution (lancement le 30 décembre 2005)	(10,33 %)	5,60 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 22 juin 2016)	(10,63 %)	3,08 %
Administrations, capitalisation (lancement le 27 juin 2008)	(10,72 %)	5,07 %
Administrations, distribution (lancement le 11 décembre 2015)	(10,68 %)	3,60 %
BM Détail, distribution II (lancement le 28 avril 2022)	—	(3,86 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 11 septembre 2006)	(11,08 %)	4,55 %
Catégorie E, distribution (lancement le 31 juillet 2006)	(11,10 %)	4,62 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 29 août 2008)	(10,43 %)	5,54 %
H Institutions, distribution (lancement le 22 mars 2013)	(10,35 %)	3,40 %
M Détail, distribution (lancement le 30 novembre 2010)	(11,04 %)	3,88 %
M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013)	(11,18 %)	2,49 %
Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	(10,55 %)	3,57 %
Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014)	(11,43 %)	2,17 %
Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014)	(11,42 %)	2,16 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en USD[3]	(10,04 %)	5,94 %[2]
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 16 février 2010)	(12,67 %)	3,68 %
Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 31 août 2012)	(12,66 %)	2,20 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en CHF[3]	(12,58 %)	4,05 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 mai 2008)	(12,28 %)	4,20 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)	(12,26 %)	4,48 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 5 janvier 2011)	(12,60 %)	2,93 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	(13,06 %)	3,45 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 29 avril 2016)	(13,10 %)	0,46 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en EUR[3]	(12,25 %)	4,63 %[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 25 mai 2012)	(11,23 %)	3,71 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)	(11,08 %)	5,19 %
Catégorie E en GBP (couverte), distribution (lancement le 15 juin 2009)	(11,95 %)	5,00 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en GBP[3]	(11,27 %)	5,37 %[2]
Catégories libellées en SGD		
Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 25 avril 2016)	(11,38 %)	2,24 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en SGD[3]	(10,46 %)	3,59 %

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*
3 *La performance de l'indice de référence du Fonds Global High Yield Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 31 mars 2014 : Indice ICE BofA Merrill Lynch Global High Yield, BB-B Rated, Constrained Index ; à partir du 1er avril 2014 : Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en USD.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sous-pondération du secteur de l'immobilier a contribué à la performance, en raison de la sous-performance du secteur.

» La sélection de titres dans le secteur de la vente au détail a contribué à la performance, certains émetteurs surpondérés ayant surperformé.

» La sélection de titres dans le secteur des biens de consommation non cycliques a contribué à la performance, un émetteur surpondéré ayant surperformé.

» La surpondération du secteur de la santé a nui à la performance, le secteur ayant sous-performé.

» La sélection de titres dans le secteur de la finance et de l'assurance a nui à la performance, un émetteur surpondéré ayant sous-performé.

Fonds Global Investment Grade Credit Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 18 avril 2008)	(15,52 %)	4,02 %
Institutions, distribution (lancement le 23 juillet 2003)	(15,51 %)	4,27 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 15 février 2005)	(15,82 %)	3,64 %
Investisseurs, distribution (lancement le 22 janvier 2009)	(15,77 %)	4,29 %
Administrations, capitalisation (lancement le 21 janvier 2009)	(15,97 %)	4,12 %
Administrations, distribution (lancement le 21 janvier 2009)	(15,89 %)	4,13 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 10 décembre 2008)	(16,28 %)	3,91 %
Catégorie E, distribution (lancement le 30 avril 2008)	(16,29 %)	3,04 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 29 août 2008)	(15,68 %)	3,99 %
H Institutions, distribution (lancement le 25 mai 2018)	(15,61 %)	(0,20 %)
M Détail, distribution (lancement le 28 septembre 2012)	(16,27 %)	1,18 %
M Détail, distribution II (lancement le 23 décembre 2013)	(16,24 %)	1,29 %
Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	(15,76 %)	1,66 %
Catégorie R, distribution (lancement le 30 novembre 2012)	(15,76 %)	1,67 %
Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014)	(16,59 %)	0,31 %
Catégorie W, capitalisation (lancement le 12 août 2020)	(15,42 %)	(6,08 %)
Catégorie W, distribution (lancement le 12 août 2020)	(15,40 %)	(6,03 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD)	(14,22 %)	3,59 %[2]
Catégories libellées en USD (exposition au risque de change)		
Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 2 août 2013)	(18,07 %)	0,93 %
Institutions (exposition au risque de change), distribution (lancement le 6 septembre 2016)	(18,12 %)	(0,50 %)
H Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 26 février 2021)	(18,17 %)	(11,04 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (non couvert en USD)	(16,96 %)	0,91 %[2]
Catégories libellées en AUD		
Institutions en AUD (couverte), distribution (lancement le 7 avril 2020)	(16,45 %)	(2,79 %)
Investisseurs en AUD (couverte), distribution (lancement le 25 juin 2018)	(16,83 %)	(1,11 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en AUD)	(15,50 %)	(0,05 %)[2]
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 10 décembre 2009)	(17,73 %)	1,88 %
Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 6 février 2015)	(17,78 %)	(0,92 %)
Investisseurs en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 10 mai 2011)	(18,00 %)	0,70 %
Investisseurs en CHF (couverte), distribution (lancement le 22 janvier 2009)	(17,96 %)	2,70 %
Administrations en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 31 janvier 2013)	(18,11 %)	(0,47 %)
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 6 mars 2012)	(18,46 %)	(0,14 %)
Catégorie W en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)	(17,65 %)	(7,70 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en CHF)	(16,79 %)	2,30 %[2]
Catégories libellées en CZK		
Institutions en CZK (couverte), distribution (lancement le 19 mai 2015)	(12,42 %)	0,66 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en CZK)	(11,16 %)	0,93 %
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 15 septembre 2003)	(17,35 %)	3,35 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 15 septembre 2008)	(17,34 %)	3,23 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 8 mai 2006)	(17,66 %)	2,80 %
Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 22 janvier 2009)	(17,70 %)	3,22 %
Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 17 février 2009)	(17,79 %)	2,95 %
Administrations en EUR (couverte), distribution (lancement le 17 février 2009)	(17,79 %)	2,95 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	(18,13 %)	2,19 %

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

- Les stratégies macro ont contribué à la performance en raison d'une sous-pondération de la duration des marchés développés.
- La sélection de titres dans le secteur des jeux a contribué à la performance, certains émetteurs surpondérés ayant surperformé.
- La sélection de titres au sein de la dette extérieure des marchés émergents a nui à la performance, l'exposition à la dette russe ayant sous-performé.
- La surpondération et la sélection de titres dans les sociétés d'investissement immobilier ont nui à la performance, le secteur ayant sous-performé.
- La surpondération et la sélection de titres du secteur bancaire ont nui à la performance, l'exposition à certaines obligations senior et subordonnées ayant sous-performé.

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1] (suite)

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 9 septembre 2010)	(18,13 %)	0,89 %
Catégorie R en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012)	(17,54 %)	0,18 %
Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)	(18,46 %)	(1,38 %)
Catégorie W en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)	(17,31 %)	(7,46 %)
Catégorie W en EUR (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)	(17,34 %)	(7,45 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en EUR)	(16,39 %)	2,63 %[2]
Catégories libellées en EUR (exposition au risque de change)		
Institutions en EUR (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 16 août 2012)	(12,77 %)	2,33 %
Catégorie E en EUR (exposition au risque de change), distribution (lancement le 12 décembre 2018)	(13,50 %)	(0,39 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (non couvert en EUR)	(11,52 %)	2,51 %[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 2 septembre 2005)	(16,28 %)	3,68 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 11 juillet 2008)	(16,30 %)	3,82 %
Investisseurs en GBP (couverte), distribution (lancement le 22 janvier 2009)	(16,59 %)	3,83 %
Administrations en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 janvier 2009)	(16,73 %)	3,65 %
Catégorie E en GBP (couverte), distribution (lancement le 31 mars 2009)	(17,09 %)	3,33 %
Catégorie R en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012)	(16,46 %)	1,01 %
Catégorie W en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 12 août 2020)	(16,26 %)	(6,58 %)
Catégorie W en GBP (couverte), distribution (lancement le 12 août 2020)	(16,15 %)	(6,53 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en GBP)	(15,34 %)	3,13 %[2]
Catégories libellées en HKD		
Administrations en HKD (non couverte), distribution (lancement le 28 juillet 2017)	(15,91 %)	(0,49 %)
M Détail en HKD (non couverte), distribution (lancement le 28 juillet 2017)	(16,17 %)	(0,87 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD) libellé en HKD	(14,13 %)	0,65 %
Catégories libellées en NOK		
Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 18 janvier 2012)	(16,39 %)	2,69 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en NOK)	(15,43 %)	2,53 %
Catégories libellées en SEK		
Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 4 décembre 2009)	(16,96 %)	2,80 %
Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 13 décembre 2012)	(17,35 %)	0,15 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en SEK)	(16,16 %)	2,40 %[2]
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015)	(15,63 %)	1,31 %
Investisseurs en SGD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018)	(16,00 %)	(0,67 %)
Administrations en SGD (couverte), distribution (lancement le 22 septembre 2017)	(16,12 %)	(1,04 %)
Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 18 juillet 2012)	(16,49 %)	1,19 %
Catégorie W en SGD (couverte), distribution (lancement le 13 octobre 2020)	(15,57 %)	(6,80 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en SGD)	(14,57 %)	2,08 %[2]

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 28 septembre 2018)	(14,74 %)	0,95 %
Institutions, distribution (lancement le 19 juillet 2019)	(14,77 %)	(1,51 %)
Investisseurs, capitalisation (lancement le 4 mai 2021)	(15,06 %)	(8,88 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 28 février 2020)	(15,56 %)	(4,86 %)
Catégorie E, distribution (lancement le 28 février 2020)	(15,59 %)	(4,86 %)
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 20 juin 2019)	(14,34 %)	(0,74 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD)	(14,22 %)	0,65 %[2]
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 28 septembre 2018)	(17,03 %)	(1,44 %)
Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 28 février 2020)	(17,05 %)	(5,79 %)
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2020)	(17,88 %)	(6,67 %)
Catégorie E en CHF (couverte), distribution (lancement le 28 février 2020)	(17,81 %)	(6,64 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en CHF)	(16,79 %)	(1,76 %)[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 septembre 2018)	(16,67 %)	(1,08 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 28 février 2020)	(16,72 %)	(5,49 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2020)	(17,41 %)	(6,35 %)
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 28 février 2020)	(17,41 %)	(6,35 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en EUR)	(16,39 %)	(1,38 %)[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 28 septembre 2018)	(15,63 %)	(0,16 %)
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 1er mai 2019)	(15,55 %)	(1,44 %)
Catégorie E en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2020)	(16,44 %)	(5,60 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en GBP)	(15,34 %)	(0,43 %)[2]
Catégories libellées en SEK		
Institutions en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 3 novembre 2022)	—	3,70 %
Administrations en SEK (couverte), capitalisation (lancement le 27 novembre 2019)	(16,71 %)	(4,39 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en SEK)	(16,16 %)	(4,09 %)[2]

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» Les stratégies macro ont contribué à la performance en raison d'une sous-pondération de la duration des marchés développés.

» L'exposition nulle à la dette russe a contribué à la performance, la dette russe ayant sous-performé le marché en général.

» La surpondération des sociétés d'investissement immobilier a nui à la performance, le secteur ayant sous-performé le marché en général.

» La surpondération au secteur bancaire et du courtage a nui à la performance, le secteur ayant sous-performé le marché en général.

» La sous-pondération des secteurs de l'énergie et des pipelines a nui à la performance, les secteurs ayant surperformé le marché en général.

Fonds Global Low Duration Real Return Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 18 février 2014)	(1,26 %)	1,88 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 5 octobre 2016)	(1,64 %)	2,15 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 18 février 2014)	(2,24 %)	0,97 %
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en USD)	(1,50 %)	1,87 %[2]
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 février 2014)	(3,61 %)	(0,14 %)
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en CHF)	(3,97 %)	(0,20 %)
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 18 février 2014)	(3,30 %)	0,28 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 17 janvier 2017)	(3,28 %)	0,43 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 18 février 2014)	(4,15 %)	(0,62 %)
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en EUR)	(3,53 %)	0,28 %[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 20 janvier 2017)	(1,80 %)	1,44 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 18 février 2014)	(1,88 %)	1,18 %
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en GBP)	(2,26 %)	1,17 %[2]
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 22 septembre 2022)	—	0,60 %
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en SGD)	—	0,05 %

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sous-pondération des taux d'intérêt souverains nominaux allemands a contribué à la performance relative, les rendements nominaux allemands ayant augmenté.

» La sous-pondération des taux d'intérêt souverains nominaux américains a contribué à la performance relative, les rendements nominaux américains ayant augmenté.

» La sous-pondération des taux d'intérêt souverains nominaux italiens a contribué à la performance relative, les rendements nominaux italiens ayant augmenté.

» La surpondération des obligations couvertes danoises a nui à la performance relative, ces titres ayant sous-performé.

» La surpondération des titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux américains (MBS) a nui à la performance relative, les écarts des MBS émis par des organismes gouvernementaux américains s'étant creusés.

» La surpondération des taux d'intérêt souverains réels italiens a nui à la performance relative, les rendements réels italiens ayant augmenté.

Fonds Global Real Return Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 30 septembre 2003)	(16,19 %)	4,08 %
Institutions, distribution (lancement le 30 décembre 2005)	(16,22 %)	3,70 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 4 mars 2004)	(16,47 %)	3,55 %
Investisseurs, distribution (lancement le 24 février 2009)	(16,51 %)	3,98 %
Administrations, capitalisation (lancement le 17 décembre 2004)	(16,61 %)	3,28 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	(16,94 %)	2,93 %
Catégorie E, distribution (lancement le 28 octobre 2005)	(16,93 %)	2,83 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 21 mai 2004)	(16,35 %)	3,88 %
Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	(16,43 %)	1,70 %
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en USD)	(17,00 %)	3,86 %[2]
Catégories libellées en USD (exposition au risque de change)		
Institutions (exposition au risque de change), capitalisation (lancement le 1er septembre 2017)	(20,99 %)	(0,47 %)
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (non couvert en USD)	(21,86 %)	(0,72 %)
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 16 mai 2008)	(18,41 %)	1,90 %
Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015)	(18,44 %)	0,10 %
Investisseurs en CHF (couverte), distribution (lancement le 24 février 2009)	(18,70 %)	2,36 %
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en CHF)	(19,37 %)	1,58 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2003)	(18,11 %)	3,13 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)	(18,17 %)	2,66 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 7 avril 2004)	(18,43 %)	2,65 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	(18,85 %)	1,92 %
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en EUR)	(18,94 %)	2,87 %[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 5 février 2004)	(17,29 %)	4,06 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 27 avril 2005)	(17,26 %)	3,60 %
Catégorie R en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	(17,49 %)	1,03 %
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en GBP)	(18,10 %)	3,88 %[2]
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 29 février 2008)	(16,35 %)	3,14 %
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en SGD)	(17,32 %)	2,99 %

[1] *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
[2] *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sous-pondération des taux d'intérêt réels souverains du Royaume-Uni a contribué à la performance relative, les rendements réels du Royaume-Uni ayant augmenté.

» La sous-pondération des taux d'intérêt souverains nominaux allemands a contribué à la performance relative, les rendements nominaux allemands ayant augmenté.

» La sous-pondération des taux d'intérêt souverains nominaux américains a contribué à la performance relative, les rendements nominaux américains ayant augmenté.

» La surpondération des obligations couvertes danoises a nui à la performance relative, ces titres ayant sous-performé.

» La surpondération des taux d'intérêt souverains nominaux britanniques a pesé sur la performance relative, les rendements nominaux britanniques ayant augmenté.

» La surpondération des titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux américains (MBS) a nui à la performance relative, les écarts des MBS émis par des organismes gouvernementaux américains s'étant creusés.

Fonds Income Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	(7,49 %)	4,64 %
Institutions, distribution (lancement le 30 novembre 2012)	(7,52 %)	4,65 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 20 janvier 2015)	(7,82 %)	3,20 %
Investisseurs, distribution (lancement le 18 avril 2013)	(7,91 %)	3,41 %
Administrations, capitalisation (lancement le 13 février 2017)	(7,93 %)	2,22 %
Administrations, distribution (lancement le 30 novembre 2012)	(7,95 %)	4,13 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	(8,38 %)	3,71 %
Catégorie E, distribution (lancement le 30 novembre 2012)	(8,37 %)	3,70 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 25 mai 2018)	(7,68 %)	2,21 %
H Institutions, distribution (lancement le 25 mai 2018)	(7,68 %)	2,21 %
Catégorie R, capitalisation (lancement le 7 novembre 2019)	(7,78 %)	0,60 %
Catégorie R, distribution (lancement le 30 avril 2015)	(7,77 %)	3,07 %
Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014)	(8,78 %)	2,09 %
Catégorie T, distribution (lancement le 16 octobre 2014)	(8,67 %)	2,11 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	(7,02 %)	5,20 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index	(13,01 %)	1,03 %[2]
Catégories libellées en AUD		
Institutions en AUD (couverte), capitalisation (lancement le 17 janvier 2018)	(8,71 %)	1,17 %
Investisseurs en AUD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018)	(8,94 %)	1,14 %
Administrations en AUD (couverte), distribution (lancement le 8 juin 2016)	(9,12 %)	2,30 %
Catégorie E en AUD (couverte), distribution (lancement le 16 février 2017)	(9,44 %)	1,19 %
Catégorie Z en AUD (couverte), distribution II (lancement le 28 octobre 2015)	(8,23 %)	3,71 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en AUD)	(14,24 %)	0,60 %[2]
Catégories libellées en BRL		
Institutions en BRL (couverte), capitalisation (lancement le 3 février 2016)	6,53 %	4,67 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en BRL)	(2,20 %)	6,83 %
Catégories libellées en CAD		
Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 1er avril 2016)	(7,83 %)	3,05 %
Institutions en CAD (couverte), distribution (lancement le 7 septembre 2018)	(7,90 %)	2,01 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CAD)	(13,39 %)	0,07 %[2]
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 décembre 2014)	(9,98 %)	1,30 %
Institutions en CHF (couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015)	(10,01 %)	1,00 %
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 18 février 2014)	(10,80 %)	0,71 %
Catégorie E en CHF (couverte), distribution (lancement le 18 février 2014)	(10,77 %)	0,71 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CHF)	(15,62 %)	(0,92 %)[2]
Catégories libellées en CNH		
Investisseurs en RMB (couverte), capitalisation (lancement le 3 janvier 2018)	(7,53 %)	2,93 %
Catégorie E en RMB (couverte), distribution (lancement le 22 mai 2013)	(8,05 %)	4,70 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CNH)	(12,91 %)	3,36 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	(9,63 %)	3,10 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012)	(9,66 %)	3,09 %
Institutions en EUR (couverte), distribution II (lancement le 29 juillet 2014)	(9,67 %)	1,65 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 10 avril 2015)	(10,00 %)	1,00 %
Investisseurs en EUR (couverte), distribution (lancement le 7 mai 2015)	(9,99 %)	1,07 %
Investisseurs en EUR (couverte), distribution A (lancement le 16 décembre 2015)	(10,00 %)	1,19 %

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» L'exposition courte à la duration britannique a contribué à la performance, car les taux d'intérêt britanniques ont augmenté.

» L'exposition courte à la duration japonaise a contribué à la performance, les rendements japonais ayant augmenté.

» L'exposition longue au réal brésilien a contribué à la performance, cette devise s'étant apprécié face au dollar américain.

» L'exposition longue à la duration américaine a nui à la performance, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.

» Les positions sur le crédit titrisé, à savoir des titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux, ont nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

» L'exposition longue au crédit d'entreprise à haut rendement a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1] (suite)

	1 an	Lancement de la catégorie
Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 14 août 2015)	(10,05 %)	0,97 %
Administrations en EUR (couverte), distribution (lancement le 8 juin 2016)	(10,13 %)	0,68 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	(10,45 %)	2,18 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012)	(10,47 %)	2,18 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution II (lancement le 31 août 2018)	(10,48 %)	(0,53 %)
Catégorie E en EUR (couverte), distribution II Q (lancement le 30 septembre 2019)	(10,47 %)	(1,62 %)
G Détail en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 août 2017)	(10,45 %)	(0,95 %)
Catégorie R en EUR (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2016)	(9,94 %)	1,32 %
Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)	(10,86 %)	0,31 %
Catégorie T en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 septembre 2014)	(10,88 %)	0,31 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en EUR)	(15,19 %)	(0,42 %)[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 7 février 2019)	(8,41 %)	0,86 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 15 février 2013)	(8,36 %)	3,11 %
Investisseurs en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2020)	(8,74 %)	(1,11 %)
Administrations en GBP (couverte), distribution (lancement le 2 septembre 2016)	(8,79 %)	1,29 %
Catégorie E en GBP (couverte), distribution (lancement le 15 mars 2017)	(9,18 %)	0,49 %
Catégorie R en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012)	(8,66 %)	3,62 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en GBP)	(14,06 %)	0,45 %[2]
Catégories libellées en HKD		
Institutions en HKD (non couverte), distribution (lancement le 30 octobre 2015)	(7,40 %)	3,54 %
Administrations en HKD (non couverte), distribution (lancement le 26 avril 2017)	(7,82 %)	2,05 %
Catégorie E en HKD (non couverte), distribution (lancement le 4 février 2013)	(8,32 %)	3,02 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (non couvert en HKD)	(12,91 %)	1,20 %[2]
Catégories libellées en JPY		
Catégorie E en JPY (couverte), capitalisation (lancement le 1er septembre 2017)	(10,70 %)	(0,76 %)
Catégorie E en JPY (couverte), distribution (lancement le 21 décembre 2022)	—	(0,80 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en JPY)	(15,79 %)	(2,00 %)[2]
Catégories libellées en NOK		
Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 19 avril 2017)	(8,63 %)	1,38 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en NOK)	(14,12 %)	(0,50 %)
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 14 juillet 2020)	(7,72 %)	0,65 %
Institutions en SGD (couverte), distribution (lancement le 16 décembre 2015)	(7,72 %)	3,34 %
Investisseurs en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 7 février 2020)	(8,04 %)	(0,56 %)
Investisseurs en SGD (couverte), distribution (lancement le 23 mai 2018)	(8,04 %)	1,67 %
Administrations en SGD (couverte), distribution (lancement le 30 novembre 2012)	(8,19 %)	3,97 %
Catégorie E en SGD (couverte), distribution (lancement le 19 février 2013)	(8,53 %)	2,80 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SGD)	(13,32 %)	0,96 %[2]

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Fonds Income Fund II

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 29 janvier 2021)	(7,77 %)	(3,28 %)
Catégorie E, distribution (lancement le 29 janvier 2021)	(8,53 %)	(4,13 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index	(13,01 %)	(7,40 %)
Catégories libellées en AUD		
Catégorie E en AUD (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2021)	(9,60 %)	(4,81 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en AUD)	(14,24 %)	(8,16 %)
Catégories libellées en EUR		
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 17 février 2021)	(10,70 %)	(5,82 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en EUR)	(15,19 %)	(8,87 %)
Catégories libellées en GBP		
Catégorie E en GBP (couverte), distribution (lancement le 17 février 2021)	(9,28 %)	(4,77 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en GBP)	(14,06 %)	(7,92 %)
Catégories libellées en HKD		
Catégorie E en HKD (non couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2021)	(8,46 %)	(3,80 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (non couvert en HKD)	(12,91 %)	(7,08 %)

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» L'exposition courte à la duration britannique a contribué à la performance, car les taux d'intérêt britanniques ont augmenté.

» L'exposition longue au réal brésilien a contribué à la performance, cette devise s'étant apprécié face au dollar américain.

» L'exposition courte à la duration japonaise a contribué à la performance, les rendements japonais ayant augmenté.

» L'exposition longue à la duration américaine a nui à la performance, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.

» L'exposition longue au crédit d'entreprise à haut rendement a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

» L'exposition sélective à la dette extérieure des pays émergents a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

Fonds Inflation Multi-Asset Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 14 février 2013)	(5,12 %)	1,09 %
Administrations, distribution II (lancement le 22 mars 2022)	—	(9,20 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 14 février 2013)	(6,07 %)	(0,10 %)
Catégorie E, distribution II (lancement le 2 août 2022)	—	(5,63 %)
H Institutions, capitalisation (lancement le 23 août 2022)	—	(5,50 %)
M Détail, distribution II (lancement le 2 août 2022)	—	(5,66 %)
45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en USD), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en USD), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en USD), et 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return Index pondéré (couvert en USD)[3]	(5,31 %)	1,02 %[2]
Catégories libellées en AUD		
Catégorie E en AUD (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 18 août 2022)	—	(6,50 %)
45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en AUD), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en AUD), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index (couvert en AUD), 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en AUD), et 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return Index pondéré (couvert en AUD)[3]	—	(5,35 %)
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 18 novembre 2021)	(5,22 %)	(5,02 %)
Catégorie E en EUR (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 16 avril 2013)	(6,17 %)	(0,77 %)
Catégorie E en EUR (partiellement couverte), distribution (lancement le 16 avril 2013)	(6,23 %)	(0,77 %)
45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en EUR), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en EUR), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index (couvert en EUR), 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en EUR), et 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return Index pondéré (couvert en EUR)[3]	(4,56 %)	0,68 %[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 30 mai 2014)	(3,03 %)	1,65 %
Catégorie E en GBP (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 2 août 2022)	—	(5,90 %)
45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en GBP), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en GBP), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index (couvert en GBP), 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en GBP), et 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return Index pondéré (couvert en GBP)[3]	(2,38 %)	1,59 %[2]
Catégories libellées en SGD		
Administrations en SGD (partiellement couverte), distribution II (lancement le 22 février 2022)	—	(6,75 %)
Catégorie E en SGD (partiellement couverte), capitalisation (lancement le 2 août 2022)	—	(6,40 %)
45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1-30yrs Index (couvert en SGD), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en SGD), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index (couvert en SGD), 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en SGD), et 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return Index (couvert en SGD)[3]	—	(7,68 %)[2]

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

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sous-pondération des taux d'intérêt du Royaume-Uni a contribué à la performance relative, les taux d'intérêt du Royaume-Uni ayant augmenté au cours de la période.

» La surpondération du point mort d'inflation (« PMI ») européen, ou l'écart de rendement entre les obligations d'État nominales et les obligations indexées sur l'inflation de même échéance a contribué à la performance relative, le PMI européen ayant augmenté.

» La sous-pondération des taux d'intérêt allemands a contribué à la performance relative, les taux d'intérêt allemands ayant augmenté au cours de la période.

» La surpondération des taux d'intérêt danois via les obligations couvertes danoises a nui à la performance relative, les taux d'intérêt danois ayant augmenté au cours de la période.

» La surpondération des taux d'intérêt américains (principalement les taux réels) a nui à la performance relative, les taux américains ayant augmenté au cours de cette période.

» La sous-pondération du PMI britannique, notamment de janvier à août, a nui à la performance relative, le PMI britannique ayant augmenté au cours de cette période.

Fonds Low Average Duration Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 5 décembre 2002)	(4,82 %)	2,24 %
Institutions, distribution (lancement le 5 décembre 2002)	(4,84 %)	2,23 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 13 mai 2004)	(5,19 %)	1,92 %
Investisseurs, distribution (lancement le 3 juillet 2003)	(5,22 %)	1,81 %
Administrations, capitalisation (lancement le 8 septembre 2004)	(5,32 %)	1,73 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 21 septembre 2007)	(5,71 %)	1,09 %
Catégorie E, distribution (lancement le 28 octobre 2005)	(5,70 %)	1,39 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 4 novembre 2009)	(4,95 %)	1,21 %
H Institutions, distribution (lancement le 12 décembre 2018)	(4,94 %)	0,32 %
Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	(5,17 %)	0,44 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index	(3,65 %)	1,72 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 janvier 2012)	(6,81 %)	(0,27 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)	(6,75 %)	1,34 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 24 juillet 2009)	(7,52 %)	(0,37 %)
Indice ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (couvert en EUR)	(5,66 %)	0,75 %[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 20 janvier 2017)	(5,34 %)	(0,42 %)
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 1er mars 2010)	(5,30 %)	0,89 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index (couvert en GBP)	(4,27 %)	0,41 %[2]

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sous-pondération de la duration américaine sur la partie à deux ans de la courbe des taux a contribué à la performance relative, les taux d'intérêt américains sur la partie initiale de la courbe ayant augmenté.

» La sous-pondération de la duration du Royaume-Uni sur la partie à dix ans de la courbe des taux a contribué à la performance relative, les taux d'intérêt du Royaume-Uni ayant augmenté.

» Les positions sélectives au sein des indices de swaps de défaillance des entreprises à haut rendement ont nui à la performance relative, les écarts des entreprises à haut rendement s'étant resserrés au cours du quatrième trimestre de 2022.

» Les positions sur les titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux ont nui à la performance relative, cette catégorie d'actifs ayant généré un rendement total négatif.

» La surpondération de la duration européenne sur la partie à deux ans et à trois ans de la courbe des taux a nui à la performance relative, les taux d'intérêt européens ayant augmenté.

Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 28 février 2014)	(5,37 %)	1,54 %
Institutions, distribution (lancement le 22 juin 2021)	(5,40 %)	(4,35 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en USD)	(6,00 %)	1,58 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2014)	(7,34 %)	(0,03 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 3 juin 2021)	(7,31 %)	(5,81 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2014)	(8,09 %)	(0,94 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en EUR)	(8,06 %)	(0,03 %)[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 28 février 2014)	(6,02 %)	0,84 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 3 juin 2021)	(6,01 %)	(4,73 %)
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en GBP)	(6,79 %)	0,87 %[2]
Catégories libellées en NOK		
Institutions en NOK (couverte), capitalisation (lancement le 10 juillet 2017)	(6,01 %)	0,11 %
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en NOK)	(6,71 %)	0,40 %

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» Les stratégies macro ont contribué à la performance en raison d'une sous-pondération de la duration des marchés développés.

» La sélection de titres dans le secteur des jeux a contribué à la performance, certains émetteurs surpondérés ayant surperformé.

» La sélection de titres dans le secteur bancaire a contribué à la performance, certains émetteurs surpondérés ayant surperformé.

» La sélection de titres au sein de la dette extérieure des marchés émergents a nui à la performance, l'exposition à la dette russe ayant sous-performé.

» L'exposition au secteur de la titrisation, qui a affiché un rendement total négatif pour l'année, a nui à la performance.

Fonds Low Duration Income Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 mai 2018)	(3,80 %)	1,88 %
Institutions, distribution (lancement le 31 mai 2018)	(3,74 %)	1,90 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mai 2018)	(4,55 %)	1,03 %
Catégorie E, distribution (lancement le 14 septembre 2018)	(4,59 %)	0,98 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 3 septembre 2020)	(3,99 %)	0,47 %
H Institutions, distribution (lancement le 18 janvier 2022)	—	(3,49 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index	(3,72 %)	0,93 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mai 2018)	(5,88 %)	(0,15 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 22 novembre 2021)	(5,36 %)	(4,76 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mai 2018)	(6,65 %)	(1,02 %)
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 31 mai 2018)	(6,69 %)	(1,02 %)
Catégorie Z en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 3 juin 2020)	(5,38 %)	0,81 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (couvert en EUR)	(5,75 %)	(1,03 %)[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 31 mai 2018)	(4,51 %)	0,80 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 31 mai 2018)	(4,48 %)	0,79 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (couvert en GBP)	(4,37 %)	0,02 %
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 14 octobre 2020)	(3,89 %)	0,54 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index (couvert en SGD)	(3,81 %)	(1,82 %)

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» L'exposition courte à la duration du Royaume-Uni a contribué à la performance, les taux d'intérêt ayant augmenté.

» L'exposition courte à la duration japonaise a contribué à la performance, les rendements ayant augmenté.

» L'exposition longue au rouble russe a contribué à la performance, car cette devise s'est appréciée face au dollar américain.

» L'exposition longue à la duration américaine a nui à la performance, les taux d'intérêt ayant augmenté.

» L'exposition longue au crédit d'entreprise à haut rendement a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

» Les positions sur le crédit titrisé, à savoir des titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux, ont nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

Fonds Low Duration Opportunities Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 29 janvier 2016)	(7,35 %)	1,33 %
Institutions, distribution (lancement le 7 mars 2019)	(7,28 %)	(0,12 %)
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 15 septembre 2021)	(6,95 %)	(5,93 %)
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index[3]	1,69 %	1,19 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 29 janvier 2016)	(9,37 %)	(0,62 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 4 avril 2018)	(9,31 %)	(1,51 %)
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 janvier 2018)	(9,64 %)	(1,92 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 20 octobre 2017)	(9,96 %)	(2,30 %)
Taux à court terme en euro (ESTER)[4]	(0,02 %)	(0,37 %)[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 29 janvier 2016)	(7,98 %)	0,37 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 janvier 2019)	(7,98 %)	(0,78 %)
Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index[5]	1,42 %	0,53 %[2]

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*
3 *La performance de l'indice de référence du Fonds Low Duration Opportunities Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 30 juin 2022 : Indice LIBOR USD à 1 mois ; à partir du 1er juillet 2022 : Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.*
4 *La performance de l'indice de référence du Fonds Low Duration Opportunities Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2021 : Indice Euribor à 1 mois ; à partir du 1er juillet 2021 : Taux à court terme en euro (ESTER).*
5 *La performance de l'indice de référence du Fonds Low Duration Opportunities Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 30 juin 2021 : Indice LIBOR GBP à 1 mois ; à partir du 1er juillet 2021 : Indice SONIA ICE BofA SONIA Overnight Rate Index.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» L'exposition courte à la duration britannique a contribué à la performance, car les taux d'intérêt britanniques ont augmenté.

» L'exposition courte à l'euro a contribué à la performance, l'euro s'étant déprécié face au dollar américain.

» L'exposition longue au réal brésilien a contribué à la performance, cette devise s'étant appréciée face au dollar américain.

» L'exposition longue à la duration américaine a nui à la performance, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.

» L'exposition longue à la duration italienne a nui à la performance, les taux d'intérêt italiens ayant augmenté.

» Les participations dans le crédit d'entreprise de qualité « investment grade » ont nui à la performance, puisque les écarts sur ces titres se sont creusés.

Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	—	(1,00 %)
Institutions, distribution (lancement le 27 juillet 2022)	—	(0,94 %)
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index	—	1,35 %
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	—	(2,20 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 27 juillet 2022)	—	(2,16 %)
Taux à court terme en euro (ESTER)	—	0,33 %
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 27 juillet 2022)	—	(1,50 %)
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 27 juillet 2022)	—	(1,54 %)
Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index	—	1,00 %

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Le Fonds a commencé ses activités le 27 juillet 2022.

Aperçu du Fonds

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

» L'exposition courte à la duration britannique a contribué à la performance, car les taux d'intérêt britanniques ont augmenté.

» Les positions sur le crédit d'entreprise de qualité « investment grade » ont contribué à la performance, les écarts sur ces titres s'étant resserrés.

» L'exposition longue à la duration américaine a nui à la performance, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.

» L'exposition longue à la duration européenne a nui à la performance, les taux d'intérêt européens ayant augmenté.

» L'exposition longue à la duration canadienne a nui à la performance, les taux d'intérêt canadiens ayant augmenté.

Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 25 novembre 2014)	25,71 %	0,21 %
Institutions, distribution (lancement le 25 novembre 2014)	25,65 %	0,20 %
Catégorie E, distribution (lancement le 25 novembre 2014)	24,58 %	(0,97 %)
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 7 juin 2019)	27,02 %	7,35 %
Indice Alerian MLP Index	30,92 %	(2,39 %)[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 novembre 2014)	22,70 %	(1,77 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 novembre 2014)	22,54 %	(1,76 %)
Indice Alerian MLP Index en EUR (couvert)	28,13 %	(4,03 %)
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 25 novembre 2014)	23,90 %	(1,62 %)
Indice Alerian MLP Index en GBP (couvert)	28,96 %	(3,99 %)

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» L'exposition aux actions du secteur intermédiaire de l'énergie a contribué à la performance absolue, le secteur ayant généré des rendements positifs.

» La surpondération du secteur de la liquéfaction a contribué à la performance relative, le secteur ayant surperformé l'indice de référence.

» La surpondération des sociétés d'exploration et de production et de raffinage a contribué à la performance relative, le secteur ayant surperformé l'indice de référence.

» La sélection de titres dans le sous-secteur du transport par pipeline du gaz naturel et du pétrole a nui à la performance relative, les titres du Fonds ayant sous-performé.

» La sélection de titres dans le sous-secteur de la collecte et du traitement a nui à la performance relative, les titres du Fonds ayant sous-performé.

Fonds Mortgage Opportunities Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 25 janvier 2017)	(8,52 %)	1,21 %
Institutions, distribution (lancement le 25 janvier 2017)	(8,51 %)	1,22 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 12 mai 2017)	(8,85 %)	0,53 %
Investisseurs, distribution (lancement le 25 janvier 2017)	(8,83 %)	0,87 %
Administrations, distribution (lancement le 25 janvier 2017)	(8,96 %)	0,73 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 25 janvier 2017)	(9,34 %)	0,32 %
Catégorie E, distribution (lancement le 25 janvier 2017)	(9,40 %)	0,31 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 14 mai 2020)	(8,68 %)	(0,42 %)
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index[3]	1,78 %	1,47 %[2]
Catégories libellées en CAD		
Institutions en CAD (couverte), capitalisation (lancement le 1er juin 2021)	(8,68 %)	(4,74 %)
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en CAD)[3]	1,46 %	0,94 %
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 25 janvier 2017)	(10,79 %)	(1,14 %)
Catégorie E en CHF (couverte), distribution (lancement le 9 août 2017)	(11,66 %)	(2,62 %)
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en CHF)[3]	(0,68 %)	(0,91 %)[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 janvier 2017)	(10,41 %)	(0,77 %)
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 25 janvier 2017)	(10,35 %)	(0,76 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 25 janvier 2017)	(11,27 %)	(1,67 %)
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en EUR)[3]	(0,11 %)	(0,50 %)
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 25 janvier 2017)	(9,07 %)	0,20 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 25 janvier 2017)	(9,15 %)	0,19 %
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en GBP)[3]	1,33 %	0,50 %[2]

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*
3 *La performance de l'indice de référence du Fonds Mortgage Opportunities Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 30 juin 2022 : Indice LIBOR USD à 3 mois ; à partir du 1er juillet 2022 : Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» Les positions sur les titres adossés à des créances hypothécaires structurés émis par des organismes gouvernementaux, notamment sur les titres à intérêts uniquement, ont contribué à la performance, le secteur ayant généré des rendements positifs.

» L'exposition négative à la duration européenne a contribué à la performance, les taux européens ayant augmenté.

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

» L'exposition à des titres adossés à des créances hypothécaires résidentielles senior non émis par des organismes gouvernementaux, a nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

» Les stratégies de valeur relative en titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux ont nui à la performance, le secteur ayant généré des rendements négatifs.

Fonds StocksPLUS™ Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 décembre 1998)	(21,95 %)	6,64 %
Institutions, distribution (lancement le 22 novembre 2001)	(21,96 %)	7,82 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 7 janvier 1999)	(22,23 %)	6,14 %
BE Détail, capitalisation (lancement le 28 avril 2022)	—	(13,40 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 11 septembre 2006)	(22,65 %)	7,85 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 8 janvier 2020)	(22,05 %)	5,41 %
Indice S&P 500 Index (net de la retenue à la source sur les dividendes)	(18,51 %)	6,24 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 28 septembre 2012)	(24,30 %)	10,00 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 2 août 2017)	(24,96 %)	5,61 %
Indice S&P 500 Index (couvert en EUR) (net de la retenue à la source sur les dividendes)	(20,98 %)	9,69 %[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 17 juin 2021)	(23,76 %)	(9,33 %)
Indice S&P 500 Index (couvert en GBP) (net de la retenue à la source sur les dividendes)	(20,34 %)	(6,58 %)
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 22 avril 2022)	—	(12,40 %)
Indice S&P 500 Index (couvert en SGD) (rendement total net)	—	(11,26 %)

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» L'exposition du Fonds aux instruments dérivés sur indices boursiers liés à l'Indice S&P 500 Index a nui à la performance absolue, l'Indice S&P 500 Net Total Return Index ayant enregistré un rendement de -18,51 %.

» La stratégie alpha obligataire du Fonds a nui au rendement. Les principaux facteurs ayant eu un impact positif sur la performance comprennent les points ci-dessous :

  » Une exposition courte modeste à l'euro au cours de la période allant de janvier 2022 à octobre 2022 a contribué à la performance, l'euro s'étant déprécié par rapport au dollar américain.

  » Il n'y a pas eu d'autres contributeurs importants pour ce Fonds.

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

  » Les positions sur les titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux ont nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 29 mars 2019)	(21,70 %)	9,51 %
Indice S&P 500 Index (net de la retenue à la source sur les dividendes)	(18,51 %)	9,71 %
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 17 juin 2021)	(23,58 %)	(9,40 %)
Indice S&P 500 Index (couvert en GBP) (net de la retenue à la source sur les dividendes)	(20,34 %)	(6,58 %)

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» L'exposition du Fonds aux instruments dérivés sur indices boursiers liés à l'Indice S&P 500 Index a nui à la performance absolue, l'Indice S&P 500 Net Total Return Index ayant enregistré un rendement de -18,51 %.

» La stratégie alpha obligataire du Fonds a nui au rendement. Les principaux facteurs ayant eu un impact positif sur la performance comprennent les points ci-dessous :

  » L'exposition courte aux taux d'intérêt du Royaume-Uni à long terme a contribué à la performance, les taux d'intérêt à long terme du Royaume-Uni ayant augmenté.

  » Les positions sur les titres du Trésor protégés contre l'inflation (« TIPS ») ont contribué à la performance, le seuil de rentabilité étant positif en raison de l'inflation accumulée.

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

  » Les positions sur le segment du crédit d'entreprise de qualité « investment grade » ont nui à la performance, les écarts s'étant creusés.

Fonds Strategic Income Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 14 mars 2018)	(6,50 %)	2,45 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 16 décembre 2013)	(7,32 %)	3,20 %
Catégorie E, distribution II (lancement le 16 décembre 2013)	(7,40 %)	3,19 %
75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index / 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index[3]	(12,17 %)	3,46 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 16 décembre 2013)	(8,05 %)	2,77 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 16 décembre 2013)	(8,90 %)	1,82 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution II (lancement le 16 décembre 2013)	(8,90 %)	1,82 %
Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)	(9,24 %)	0,60 %
Catégorie T en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 septembre 2014)	(9,25 %)	0,61 %
75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Indice Aggregate Bond Index (couvert en EUR) / 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index (couvert en EUR)[3]	(13,73 %)	2,17 %[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 29 juillet 2022)	—	(1,06 %)
75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Indice Aggregate Bond Index (couvert en GBP) / 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index (couvert en GBP)[3]	—	(4,48 %)

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

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

Composante à revenu fixe :

» L'exposition courte à la duration du Royaume-Uni a contribué à la performance absolue, les taux d'intérêt du Royaume-Uni ayant augmenté.

» L'exposition courte à la duration du Japon a contribué à la performance absolue, les taux d'intérêt du Japon ayant augmenté.

» L'exposition longue au réal brésilien a contribué à la performance absolue, cette devise s'étant appréciée face au dollar américain.

» L'exposition longue à la duration américaine a nui à la performance absolue, les taux d'intérêt américains ayant augmenté.

» Les positions sur le crédit d'entreprise à haut rendement ont nui à la performance absolue, les écarts sur ces titres s'étant creusés.

» Les positions sur les titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux ont nui à la performance absolue, les écarts sur ces titres s'étant creusés.

Composante actions :

» La sélection de titres dans le secteur de l'énergie a contribué à la performance relative, les titres du Fonds dans le secteur de l'énergie ayant surperformé les titres de l'indice de référence dans le secteur de l'énergie.

» La sous-pondération et la sélection de titres dans le secteur des technologies de l'information ont contribué à la performance relative, le secteur ayant sous-performé l'indice de référence et les titres du Fonds dans le secteur des technologies de l'information ayant surperformé les titres de l'indice de référence dans ce secteur.

» La sélection de titres dans le secteur des services financiers a contribué à la performance relative, les titres du Fonds dans le secteur des services financiers ayant surperformé les titres de l'indice de référence dans ce secteur.

» La surpondération et la sélection de titres dans le secteur des services de communication ont contribué à la performance relative, ce secteur ayant surperformé l'indice de référence et les titres du Fonds dans le secteur des services de communication ayant surperformé les titres de l'indice de référence dans ce secteur.

» La sous-pondération et la position en devises au sein du secteur des soins de santé ont nui à la performance relative, le secteur ayant surperformé l'indice de référence et les positions en devises du Fonds dans le secteur des soins de santé ayant sous-performé les positions en devises de l'indice de référence dans ce secteur.

» L'exposition au secteur de l'immobilier a nui à la performance, le secteur ayant enregistré des rendements négatifs.

Fonds Total Return Bond Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 31 janvier 1998)	(15,26 %)	4,35 %
Institutions, distribution (lancement le 25 avril 2000)	(15,27 %)	4,32 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 28 janvier 1999)	(15,57 %)	3,79 %
Investisseurs, distribution (lancement le 23 octobre 2000)	(15,55 %)	3,74 %
Administrations, capitalisation (lancement le 16 mai 2003)	(15,71 %)	2,85 %
Administrations, distribution (lancement le 21 juillet 2022)	—	(4,02 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	(16,03 %)	2,58 %
Catégorie E, distribution (lancement le 10 octobre 2005)	(16,07 %)	2,49 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 15 octobre 2002)	(15,39 %)	3,49 %
H Institutions, distribution (lancement le 25 mai 2018)	(15,40 %)	(0,04 %)
Catégorie T, capitalisation (lancement le 16 octobre 2014)	(16,34 %)	(0,27 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index	(13,01 %)	3,93 %[2]
Catégories libellées en CAD		
Institutions en CAD (couverte), distribution (lancement le 2 mai 2013)	(15,52 %)	0,69 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CAD)	(13,39 %)	0,90 %
Catégories libellées en CHF		
Institutions en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 24 juin 2011)	(17,59 %)	(0,18 %)
Investisseurs en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 24 juin 2011)	(17,89 %)	(0,53 %)
Catégorie E en CHF (couverte), capitalisation (lancement le 19 septembre 2012)	(18,32 %)	(1,75 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en CHF)	(15,62 %)	(0,15 %)[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 décembre 2003)	(17,20 %)	2,50 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)	(17,20 %)	2,40 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 décembre 2004)	(17,44 %)	2,01 %
Administrations en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 14 octobre 2009)	(17,63 %)	0,61 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	(17,89 %)	1,59 %
Catégorie E en EUR (couverte), distribution (lancement le 7 mars 2012)	(17,90 %)	(0,89 %)
Catégorie R en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	(17,38 %)	(0,80 %)
Catégorie T en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2014)	(18,12 %)	(1,89 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en EUR)	(15,19 %)	2,08 %[2]
Catégories libellées en EUR (non couvertes)		
Institutions en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 13 juin 2002)	(9,68 %)	3,06 %
Catégorie E en EUR (non couverte), capitalisation (lancement le 3 mars 2021)	(10,52 %)	(2,60 %)
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (non couvert en EUR)	(7,31 %)	2,73 %[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 26 mars 2010)	(16,11 %)	1,60 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)	(16,15 %)	3,21 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en GBP)	(14,06 %)	2,82 %[2]
Catégories libellées en HKD		
Catégorie E en HKD (non couverte), capitalisation (lancement le 20 février 2013)	(15,99 %)	0,14 %
M Détail en HKD (non couverte), distribution (lancement le 20 février 2013)	(15,97 %)	0,11 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (non couvert en HKD)	(12,91 %)	1,21 %
Catégories libellées en SGD		
Institutions en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 11 janvier 2011)	(15,49 %)	1,65 %
Catégorie E en SGD (couverte), capitalisation (lancement le 15 février 2007)	(16,22 %)	2,08 %
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index (couvert en SGD)	(13,32 %)	2,61 %[2]

[1] *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
[2] *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» L'exposition courte à la duration au Royaume-Uni a contribué à la performance relative, en particulier au début de l'année, les taux d'intérêt ayant augmenté.

» L'exposition courte à la duration au Japon a contribué à la performance relative, les taux d'intérêt ayant augmenté.

» Il n'y a pas eu d'autres contributeurs importants pour ce Fonds.

» La surpondération du secteur financier sur le segment du crédit d'entreprise de qualité « investment grade » a nui à la performance relative, les écarts de crédit s'étant creusés.

» Les stratégies de taux d'intérêt dans la zone euro, y compris la sélection d'instruments, ont nui à la performance relative, les écarts de swap s'étant creusés.

» L'exposition au crédit à haut rendement a nui à la performance relative, les écarts s'étant creusés, en particulier au premier semestre de l'année.

» Les positions sur les titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux et sur d'autres actifs titrisés ont nui à la performance relative, en particulier en mai, les écarts s'étant creusés.

» La surpondération de la duration américaine, notamment de janvier à mars, a nui à la performance relative, les taux d'intérêt ayant augmenté.

Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2015)	10,75 %	3,32 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 23 septembre 2022)	—	(5,70 %)
Catégorie E, capitalisation (lancement le 30 juin 2015)	9,68 %	2,21 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 23 août 2022)	—	1,30 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 15 décembre 2021)	12,36 %	11,28 %
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index[3]	1,78 %	1,29 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2015)	9,40 %	1,63 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 23 septembre 2022)	—	(6,10 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 30 juin 2015)	8,22 %	0,52 %
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en EUR)[3]	(0,11 %)	(0,36 %)[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 18 novembre 2022)	—	(1,20 %)
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 23 septembre 2022)	—	(5,81 %)
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index (couvert en GBP)[3]	—	0,66 %[2]

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*
3 *La performance de l'Indice de référence du Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund est mesurée comme suit : du lancement au 30 juin 2022 : Indice LIBOR USD à 3 mois ; à partir du 1er juillet 2022 : Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» Les positions courtes sur la livre sterling, le yuan chinois et le dollar canadien ont contribué à la performance, les prix ayant baissé par rapport au dollar américain.

» Les positions courtes sur les taux d'intérêt du Royaume-Uni et des États-Unis ont contribué à la performance, les taux ayant augmenté.

» Les positions sur les taux d'intérêt indiens, polonais et tchèques ont nui à la performance, en raison de renversements de prix.

» Les positions sur les indices boursiers indiens, brésiliens et américains ont nui à la performance, en raison de renversements de prix.

Fonds UK Corporate Bond Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en GBP		
Institutions, capitalisation (lancement le 28 septembre 2007)	(18,51 %)	4,04 %
Institutions, distribution (lancement le 8 juillet 2016)	(18,56 %)	(0,36 %)
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 20 novembre 2019)	(18,12 %)	(4,94 %)
Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	(17,75 %)	3,79 %[2]

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sélection de titres dans le secteur bancaire a contribué à la performance, l'exposition à certaines obligations subordonnées ayant surperformé.

» La sous-pondération et la sélection de titres dans le secteur des transports ont contribué à la performance, et en particulier l'exposition nulle à un émetteur russe qui a sous-performé.

» La surpondération et la sélection de titres dans le secteur des sociétés d'investissement immobilier et de l'immobilier ont nui à la performance, le secteur ayant sous-performé le marché en général.

» La sélection de titres dans le secteur des sociétés financières a nui à la performance, un émetteur surpondéré ayant sous-performé.

» La sous-pondération du secteur de l'assurance a nui à la performance, le secteur ayant surperformé le marché en général.

Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en GBP		
Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2005)	(29,58 %)	3,93 %
Institutions, distribution (lancement le 14 août 2008)	(29,54 %)	4,92 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index[3]	(30,00 %)	3,49 %[2]

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*
3 *La performance de l'indice de référence du Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund est mesurée comme suit : du lancement jusqu'au 30 mars 2013 : Indice Markit iBoxx Sterling Non-Gilts 10+ Index ; à partir du 31 mars 2013 : Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» Les stratégies macro, et en particulier la sous-pondération de la duration, ont contribué à la performance, car les taux ont considérablement augmenté au cours de la période.

» La surpondération du secteur bancaire, en particulier au cours du second semestre de l'année lorsque le secteur s'est redressé, a contribué à la performance.

» La sous-pondération du secteur immobilier a contribué à la performance, ce secteur ayant sous-performé le marché en général.

» La sélection de titres au sein du secteur bancaire a nui à la performance, un émetteur surpondéré ayant sous-performé.

» La surpondération et la sélection de titres dans le secteur des sociétés d'investissement immobilier (REITS) ont nui à la performance, certains émetteurs surpondérés ayant sous-performé.

Fonds US High Yield Bond Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 28 mai 1998)	(12,28 %)	5,32 %
Institutions, distribution (lancement le 23 janvier 2001)	(12,20 %)	5,63 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 18 mars 1999)	(12,58 %)	4,96 %
Investisseurs, distribution (lancement le 14 janvier 1999)	(12,51 %)	4,94 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	(13,04 %)	3,99 %
Catégorie E, distribution (lancement le 31 juillet 2006)	(13,01 %)	4,06 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 15 octobre 2002)	(12,44 %)	6,34 %
H Institutions, distribution (lancement le 14 février 2020)	(12,48 %)	(1,71 %)
M Détail, distribution (lancement le 11 janvier 2012)	(13,08 %)	3,56 %
Catégorie R, capitalisation (lancement le 30 novembre 2012)	(12,48 %)	3,51 %
Catégorie Z, capitalisation (lancement le 29 juin 2016)	(11,76 %)	4,00 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index[3]	(11,24 %)	5,53 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 10 avril 2003)	(14,19 %)	4,68 %
Institutions en EUR (couverte), distribution (lancement le 30 décembre 2005)	(14,22 %)	3,88 %
Investisseurs en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 12 février 2003)	(14,56 %)	4,61 %
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 31 mars 2006)	(14,95 %)	2,89 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (couvert en EUR)[3]	(13,41 %)	5,37 %[2]
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), capitalisation (lancement le 30 septembre 2003)	(13,12 %)	5,26 %
Institutions en GBP (couverte), distribution (lancement le 22 juin 2016)	(13,13 %)	2,05 %
Indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index (couvert en GBP)[3]	(12,46 %)	5,76 %[2]

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

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

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

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» La sous-pondération du secteur du commerce de détail a contribué à la performance, en raison de la sous-performance du secteur.

» La sélection de titres dans le secteur de l'aérospatiale et de la défense a contribué à la performance, un émetteur surpondéré ayant surperformé.

» La surpondération du secteur de la santé a nui à la performance, le secteur ayant sous-performé.

» La sélection de titres dans le secteur des matériaux de construction a nui à la performance, certains émetteurs surpondérés ayant sous-performé.

» La sélection de titres dans le secteur des biens de consommation non cyclique a nui à la performance, certains émetteurs surpondérés ayant sous-performé.

Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 15 septembre 2016)	(16,80 %)	0,85 %
Institutions, distribution (lancement le 15 septembre 2016)	(16,85 %)	0,84 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 7 novembre 2019)	(17,58 %)	(4,26 %)
Catégorie E, distribution (lancement le 8 mars 2019)	(17,53 %)	(1,39 %)
H Institutions, capitalisation (lancement le 23 août 2022)	—	(2,80 %)
Indice Bloomberg U.S. Credit Index	(15,26 %)	0,96 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 15 septembre 2016)	(18,77 %)	(1,28 %)
Indice Bloomberg U.S. Credit Index (couvert en EUR)	(17,54 %)	(1,19 %)
Catégories libellées en GBP		
Institutions en GBP (couverte), distribution II (lancement le 15 septembre 2016)	(17,83 %)	(0,39 %)
Indice Bloomberg U.S. Credit Index (couvert en GBP)	(16,46 %)	(0,22 %)

1 *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
2 *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» Les stratégies macro, en raison de la sous-pondération de la duration, ont contribué à la performance.

» La sélection de titres dans le secteur des jeux a contribué à la performance, certains émetteurs surpondérés ayant surperformé.

» La sélection de titres au sein de la dette extérieure des marchés émergents a nui à la performance, l'exposition à la dette russe ayant sous-performé.

» La sélection de titres dans le secteur bancaire a nui à la performance, un émetteur surpondéré ayant sous-performé suite à l'annonce d'un plan de restructuration.

» La surpondération et la sélection de titres dans les sociétés d'investissement immobilier ont nui à la performance, le secteur ayant sous-performé.

Fonds US Short-Term Fund

Rendement annuel total moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022[1]

	1 an	Lancement de la catégorie
Catégories libellées en USD		
Institutions, capitalisation (lancement le 30 juin 2014)	0,00 %	1,51 %
Institutions, distribution (lancement le 11 mai 2020)	0,02 %	0,71 %
Investisseurs, capitalisation (lancement le 30 juin 2014)	(0,27 %)	1,16 %
Catégorie E, capitalisation (lancement le 30 juin 2014)	(0,45 %)	1,12 %
H Institutions, capitalisation (lancement le 12 décembre 2018)	(0,19 %)	1,02 %
Catégorie Z, distribution (lancement le 7 août 2014)	0,46 %	1,98 %
Indice FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index	1,50 %	0,87 %[2]
Catégories libellées en EUR		
Institutions en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 29 janvier 2016)	(1,88 %)	(0,13 %)
Catégorie E en EUR (couverte), capitalisation (lancement le 8 juin 2016)	(2,35 %)	(0,70 %)
Indice ICE BofA Merrill Lynch 3-Month U.S. Treasury Bill Index (couvert en EUR)	(0,53 %)	(0,80 %)[2]

[1] *Performance annualisée pour les périodes d'au moins un an, sinon, performance cumulée.*
[2] *La performance de l'indice de référence au lancement est calculée à partir de la date de lancement de la catégorie d'actions la plus ancienne.*

Objectif d'investissement et présentation de la stratégie

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

Aperçu du Fonds

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

» Les positions sur le crédit d'entreprise de qualité « investment grade » ont contribué à la performance relative, les revenus des obligations d'entreprises compensant les incidences de l'élargissement des écarts de crédit.

» Il n'y a pas eu d'autres contributeurs importants pour ce Fonds.

» Les positions sur les titres adossés à des créances hypothécaires émis par des organismes gouvernementaux ont nui à la performance relative, cette catégorie d'actifs ayant généré un rendement total négatif.

» La surpondération de la duration américaine sur la partie initiale de la courbe des taux américaine a nui à la performance relative, les taux d'intérêt américains sur cette partie de la courbe ayant augmenté.

» Les participations dans des titres d'organismes gouvernementaux ont nui à la performance relative, la catégorie d'actifs ayant dégagé un rendement total négatif.

Description des indices de référence

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

Description des indices de référence (suite)

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

Nom officiel des indices de référence	Description des indices
Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD)	L'Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD) est un indice non géré qui mesure à grande échelle les marchés mondiaux du revenu fixe de qualité « investment grade ». Les trois principales composantes de cet indice sont les indices US Aggregate, Pan-European Aggregate et Asian-Pacific Aggregate. Cet indice exclut les obligations d'État et les obligations titrisées. L'indice comporte également des obligations d'entreprise en Eurodollar et Euro-Yen, des titres canadiens et des titres 144A en USD de qualité « investment grade ». Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.
Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en USD)	L'Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en USD) offre une mesure à grande échelle des marchés mondiaux du revenu fixe de qualité « investment grade ». Les trois principales composantes de cet indice sont les indices US Aggregate, Pan-European Aggregate et Asian-Pacific Aggregate. L'Indice comporte également des obligations d'entreprise en Eurodollar et Euro-Yen, des titres de l'État canadien, des titres d'organismes gouvernementaux et d'entreprises, et des titres 144A en USD de qualité « investment grade ».
Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index (couvert en USD)	L'Indice Bloomberg MSCI Green Bond Index, couvert en USD, offre aux investisseurs une mesure objective et solide du marché mondial des titres à revenu fixe émis pour financer des projets présentant des avantages environnementaux directs. Une méthodologie indépendante axée sur la recherche est utilisée pour évaluer les obligations vertes éligibles à l'Indice afin de s'assurer qu'elles respectent les principes établis en matière d'obligations vertes et pour classer les obligations en fonction de leur utilisation environnementale des produits. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.
Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index	L'Indice Bloomberg US Aggregate Index représente des titres enregistrés auprès de la SEC, imposables et libellés en dollar. L'indice couvre le marché des obligations américaines à taux fixe de catégorie « investment grade », avec des composantes en titres d'État et d'entreprise, titres hypothécaires avec flux identiques (« pass-through ») et titres adossés à des actifs. Ces grands secteurs sont subdivisés en indices plus spécifiques, calculés et déclarés régulièrement. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.
Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Years Index	L'Indice Bloomberg U.S. Aggregate 1-3 Year Index représente des titres enregistrés auprès de la SEC, imposables et libellés en dollar avec une échéance de un à trois ans. L'Indice couvre le marché des obligations américaines à taux fixe de catégorie « investment grade », avec des composantes en titres d'État et d'entreprise, titres hypothécaires avec flux identiques (« pass-through ») et titres adossés à des actifs. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.
Indice Bloomberg U.S. Credit Index	L'Indice Bloomberg U.S. Credit Index est un indice non géré composé d'obligations et billets garantis d'entreprises américaines cotées et de certaines entreprises non américaines remplissant les conditions définies d'échéance, de liquidité et de qualité. Pour être admissibles, les obligations doivent être enregistrées auprès de la SEC. Cet indice était auparavant dénommé Bloomberg Credit Investment Grade. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en USD)	L'Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en USD) mesure la performance des principaux marchés des obligations d'État indexées sur l'inflation. Il englobe les dettes indexées sur l'inflation des pays suivants : Australie, Canada, France, Suède, Royaume-Uni et États-Unis. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.
Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en USD)	L'Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en USD) mesure la performance du marché mondial des obligations d'État indexées sur l'inflation ayant une échéance comprise entre un et cinq ans. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.
Taux des mises en pension au jour le jour canadien (CORRA)	Le taux des mises en pension au jour le jour canadien (CORRA) mesure le coût du financement général à un jour en dollars canadiens des garanties en utilisant les bons du Trésor et les obligations du gouvernement du Canada comme garantie des opérations de pension.
Taux à court terme en euro (ESTER)	Le taux ESTER reflète les coûts d'emprunt au jour le jour non garantis en euros de gros des banques situées dans la zone euro. Le taux ESTER est publié chaque jour où le système de paiement transeuropéen automatisé en temps réel de virement express à règlement brut (ou tout système de règlement qui lui succède) est ouvert pour le règlement des paiements en euros. Le taux ESTER est basé sur les transactions réalisées et réglées le jour ouvrable précédent (la date de déclaration « T ») avec une date d'échéance de T+1 qui sont réputées avoir été exécutées selon le principe de pleine concurrence et reflètent ainsi objectivement les taux du marché.
Indice FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index	L'Indice FTSE 3-Month U.S. Treasury Bill Index est un indice non géré représentatif des performances mensuelles équivalentes aux rendements moyens des émissions de bons du Trésor américain des 3 derniers mois. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.
Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	L'Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Index est représentatif du marché du revenu fixe de qualité « investment grade » basé sur l'euro accessible aux investisseurs institutionnels (en euro). Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.
Indice ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index	L'Indice ICE BofA Merrill Lynch 1-3 Year U.S. Treasury Index est un indice non géré composé de titres du Trésor américain, autres que les titres de protection contre l'inflation et les STRIPS, dont la valeur nominale en circulation est d'au moins 1 milliard USD et dont l'échéance résiduelle se situe entre un et trois ans. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.

Description des indices de référence (suite)

Nom officiel des indices de référence	Description des indices
Indice ICE BofA Merrill Lynch 3-Month U.S. Treasury Bill Index (couvert en EUR)	L'Indice ICE BofA Merrill Lynch 3-Month U.S. Treasury Bill Index (couvert en EUR) se compose d'une émission unique achetée en début de mois et détenue pendant un mois entier. À la fin du mois, cette émission est vendue et réinvestie dans une émission nouvellement sélectionnée. L'émission sélectionnée lors du rééquilibrage à chaque fin de mois est le bon du Trésor en circulation dont l'échéance est la plus proche d'un délai de trois mois suivant la date de rééquilibrage, sans dépasser cette limite. Pour pouvoir être sélectionnée, une émission doit avoir été réglée au plus tard à la date de rééquilibrage de fin de mois. Bien que l'indice détienne souvent le bon du Trésor émis lors de la plus récente enchère de 3 mois, il est aussi possible de choisir un bon de 6 mois plus ancien.
Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	L'Indice est conçu pour suivre la performance de titres de créance d'entreprise de qualité inférieure à « investment grade » libellés en euro et en livre sterling émis publiquement sur les marchés des euro-obligations, et les marchés nationaux en livre sterling ou en euro. Pour pouvoir être incluses dans l'Indice, les obligations doivent avoir une notation inférieure à la qualité « investment grade » ; leur notation ne peut cependant pas être inférieure à B3 selon la moyenne des notations de Moody's, S&P et Fitch. L'exposition aux émetteurs individuels au sein de l'Indice est plafonnée à 3 %. De plus amples informations sur l'Indice, y compris une description à jour de sa duration, sont disponibles sur demande auprès du Conseiller en investissement.
Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en USD	L'Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en USD reproduit la performance d'obligations de qualité inférieure à « investment grade » et émises par des sociétés domiciliées dans des pays développés dont la dette à long terme en devise étrangère est notée « investment grade » (selon la combinaison des notations de Moody's, S&P et Fitch). L'indice inclut des obligations libellées en dollar américain, en dollar canadien, en livre sterling et en euro (ou autre monnaie ayant précédé l'euro), mais exclut toutes les obligations libellées en plusieurs devises. La notation des obligations doit être inférieure à la qualité « investment grade », mais elle ne peut être inférieure à B3 selon la combinaison des notations de Moody's, S&P et Fitch. Les obligations admissibles sont pondérées par la capitalisation et l'allocation totale à un émetteur individuel (selon la définition des symboles Bloomberg) ne doit pas dépasser 2 %. Les émetteurs dépassant la limite sont réduits à 2 % et la valeur nominale de chacune de leurs obligations est ajustée au prorata. De même, dès lors que la valeur nominale des obligations de tous les autres émetteurs est inférieure au plafond de 2 %, elle est augmentée au prorata. Avant le 25 septembre 2009, les Indices ICE BofA Merrill Lynch Indices s'appelaient Indices Merrill Lynch Indices.
Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index	L'Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index est constitué d'obligations de qualité « investment grade » libellées en livre sterling, à l'exclusion des obligations libellées en livre sterling émises par le Gouvernement britannique. Toutes les obligations de l'indice doivent être notées « investment grade » par au moins une des grandes agences de notation. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.
Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	L'Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index suit la performance de la dette publique de qualité « investment grade » libellée en livre sterling des émetteurs privés, quasi-gouvernementaux et souverains non britanniques. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.
Indice ICE BofA Merrill Lynch U.S. High Yield Constrained Index	L'indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index suit la performance de la dette d'entreprise libellée en dollar américain et ayant une note inférieure à « investment grade » émise de manière publique sur le marché local américain. Les titres éligibles doivent être assortis d'une notation inférieure à « investment grade » (sur la base de la moyenne de Moody's, S&P et Fitch) et être émis par un pays dont la notation de risque est « investment grade » (sur la base de la notation moyenne des emprunts souverains à long terme en devises étrangères de Moody's, S&P et Fitch).
Indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index	L'indice ICE BofA SARON Overnight Rate Index réplique la performance d'un actif synthétique payant SARON à une échéance déterminée. L'indice repose sur l'achat supposé à la valeur nominale d'un instrument synthétique dont l'échéance correspond exactement à l'échéance fixée et dont le coupon est égal au taux de fixation du jour. Cette émission est supposée être vendue le jour ouvrable suivant (à un prix égal au taux de fixation du jour) et transformée en un nouvel instrument.
Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index	L'indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index réplique la performance d'un actif synthétique payant SOFR à une échéance déterminée. L'indice repose sur l'achat supposé à la valeur nominale d'un instrument synthétique dont l'échéance correspond exactement à l'échéance fixée et dont le coupon est égal au taux de fixation du jour. Cette émission est supposée être vendue le jour ouvrable suivant (à un prix égal au taux de fixation du jour) et transformée en un nouvel instrument. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.
Indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index	L'indice ICE BofA SONIA Overnight Rate Index réplique la performance d'un actif synthétique payant SONIA à une échéance déterminée. L'indice repose sur l'achat supposé à la valeur nominale d'un instrument synthétique dont l'échéance correspond exactement à l'échéance fixée et dont le coupon est égal au taux de fixation du jour. Cette émission est supposée être vendue le jour ouvrable suivant (à un prix égal au taux de fixation du jour) et transformée en un nouvel instrument.
Indice JPMorgan Asia Credit Index	L'Indice JPMorgan Asia Credit Index mesure la performance des marchés d'obligations libellées en USD des marchés d'Asie hors Japon. L'indice fournit une référence pour les opportunités d'investissement dans les instruments à revenu fixe libellés en dollar américain émis par les émetteurs souverains, quasi-souverains et les entreprises de l'Asie hors Japon.
Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	L'Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI) est une version uniquement pondérée de l'Indice CEMBI Index. Il limite les pondérations des indices des pays présentant d'importantes obligations d'entreprise par la seule inclusion d'une partie déterminée des montants nominaux actuels de la dette en circulation éligibles de ces pays. L'Indice CEMBI Diversified affiche donc des pondérations bien réparties et plus équilibrées des pays qui y sont représentés. Les pays que couvre l'Indice CEMBI Diversified sont identiques à ceux couverts par l'Indice CEMBI. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.
Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert)	L'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert) reproduit la performance totale des instruments monétaires libellés en devise locale de 22 pays émergents dont le commerce extérieur est supérieur ou égal à 10 milliards USD. Il n'est pas possible d'investir directement dans un indice non géré.

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

Bilan

(Montants en milliers)	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	
	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	$ 2 652 171	$ 2 901 911	$ 276 959	$ 321 481
Fonds d'investissement	239 979	330 471	29 746	33 109
Contrats de mise en pension	20 572	178 712	820	837
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	0	0
Instruments financiers dérivés	54 267	21 279	3 700	2 359
Liquidités	0	1 077	546	406
Dépôts auprès de contreparties	34 314	29 134	2 017	1 928
Produits à recevoir	48 231	49 574	3 836	3 671
À recevoir sur investissements vendus	18 600	2 394	0	0
À recevoir sur investissements vendus TBA	0	0	0	0
À recevoir sur actions du Fonds vendues	5 111	3 765	119	276
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	14 965	0	1 946	348
Autres actifs	0	0	0	0
Total de l'actif à court terme	3 088 210	3 518 317	319 689	364 415
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(27 401)	(7 650)	(1 065)	(1 643)
Juste valeur des titres vendus à découvert	0	0	0	0
À payer sur investissements achetés	(3 578)	(35 667)	0	(520)
À payer sur investissements achetés TBA	0	0	0	0
À payer sur actions du Fonds rachetées	(11 061)	(1 141)	(76)	(40)
Frais de gestion à payer	(1 671)	(1 879)	(164)	(177)
À payer sur contrats de prise en pension	0	(48 848)	0	(1 024)
À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	0	0	0	0
Charges à payer	(41)	(111)	0	0
Découvert bancaire	(13 527)	0	0	0
Dividendes à payer	(161)	(441)	0	0
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(25 632)	(1 505)	(1 842)	0
Dépôts des contreparties	(23 746)	(9 152)	(2 555)	0
Autres passifs	0	0	0	0
Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	(106 818)	(106 394)	(5 702)	(3 404)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	$ 2 981 392	$ 3 411 923	$ 313 987	$ 361 011

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

Fonds PIMCO Capital Securities Fund		Fonds PIMCO Climate Bond Fund		Fonds Commodity Real Return Fund		Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
$ 6 129 600	$ 8 423 010	$ 248 281	$ 321 810	$ 1 750 918	$ 1 554 523	$ 80 195	$ 123 472
140	481 206	0	0	120	18	9 649	13 600
10 172	62 523	36 800	0	59 113	2 098	6 910	1 827
0	0	0	0	0	0	0	0
107 561	74 595	8 236	5 077	45 313	69 845	2 563	1 325
2 624	6 410	1 484	1 636	4 491	4 953	177	399
110 882	132 617	8 041	2 349	39 055	10 065	1 533	1 806
66 969	76 123	2 192	2 026	4 250	2 590	1 002	964
33 701	0	0	0	50 448	55	206	66
0	0	0	0	206 413	30 489	1 296	205
3 060	10 758	363	473	5 062	3 576	138	1
54 526	0	1 167	0	17 822	724	1 075	563
0	0	0	0	0	0	0	0
6 519 235	9 267 242	306 564	333 371	2 183 005	1 678 936	104 744	144 228
(86 485)	(60 447)	(5 599)	(516)	(50 044)	(14 384)	(2 137)	(1 331)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	(17 037)	0	0	0	(495)	(304)	(2 056)
0	0	0	0	(288 321)	(52 442)	(3 587)	(409)
(7 922)	(3 567)	(193)	(38)	(3 460)	(812)	(50)	(600)
(4 729)	(7 145)	(145)	(159)	(1 261)	(1 257)	(89)	(124)
(578 475)	(23 339)	0	0	(425 302)	(22 915)	0	0
0	0	0	0	(17 959)	(80 800)	0	0
(237)	(798)	(24)	(11)	(15)	(19)	0	(4)
0	0	0	0	0	0	0	0
(906)	(1 313)	(157)	0	(336)	0	0	0
(77 568)	(18 973)	(3 321)	(1 086)	(18 239)	0	(833)	0
(41 321)	(24 214)	(4 470)	(3 480)	(8 191)	(61 630)	(591)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(797 644)	(156 833)	(13 909)	(5 290)	(813 128)	(234 754)	(7 591)	(4 524)
$ 5 721 591	$ 9 110 409	$ 292 655	$ 328 081	$ 1 369 877	$ 1 444 182	$ 97 153	$ 139 704

Bilan (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Diversified Income Fund		Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	
	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	$ 6 620 617	$ 14 274 019	$ 401 584	$ 1 093 527
Fonds d'investissement	876 630	1 614 943	55 806	126 929
Contrats de mise en pension	1 746 323	157 316	102 832	58 930
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	0	0
Instruments financiers dérivés	132 621	185 600	19 178	40 225
Liquidités	0	66 783	513	5 706
Dépôts auprès de contreparties	282 594	386 400	20 323	46 115
Produits à recevoir	83 844	154 187	5 122	11 642
À recevoir sur investissements vendus	51 445	554	1 998	25
À recevoir sur investissements vendus TBA	248 272	0	19 854	0
À recevoir sur actions du Fonds vendues	5 685	15 781	98	178
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	113 759	0	19 031	0
Autres actifs	0	0	0	0
Total de l'actif à court terme	10 161 790	16 855 583	646 339	1 383 277
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(150 759)	(69 821)	(5 030)	(10 316)
Juste valeur des titres vendus à découvert	0	0	0	0
À payer sur investissements achetés	(586 220)	(126 270)	(940)	(31 701)
À payer sur investissements achetés TBA	(549 539)	0	(39 365)	0
À payer sur actions du Fonds rachetées	(7 240)	(13 229)	(2 623)	(40)
Frais de gestion à payer	(8 022)	(14 404)	(438)	(1 000)
À payer sur contrats de prise en pension	(6 646)	(81 869)	0	(4 845)
À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	0	0	0	0
Charges à payer	(148)	(252)	(2)	(10)
Découvert bancaire	(3 465)	0	0	0
Dividendes à payer	(3 841)	(5 238)	(870)	(1 735)
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(62 209)	(13 641)	(29 190)	(15 275)
Dépôts des contreparties	(31 905)	(83 126)	(3 197)	(12 990)
Autres passifs	0	0	0	0
Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	(1 409 994)	(407 850)	(81 655)	(77 912)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	$ 8 751 796	$ 16 447 733	$ 564 684	$ 1 305 365

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

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

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

Fonds Diversified Income ESG Fund[1]	Fonds Dynamic Bond Fund		Fonds Dynamic Multi-Asset Fund		Fonds Emerging Local Bond Fund		Fonds Emerging Local Bond ESG Fund[2]
Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022
$ 9 978	$ 2 712 201	$ 2 900 066	€ 4 130 924	€ 6 852 548	$ 1 772 984	$ 2 324 309	$ 6 270
0	348 722	318 072	504 414	450 070	131 643	171 278	0
0	1 145 692	9 965	124 604	202 276	0	591	0
0	0	0	0	0	7 054	0	4
60	74 933	52 162	234 476	63 798	315 328	231 544	269
108	7 730	9 403	38 251	8 172	35 990	5 660	127
113	96 997	51 300	395 426	134 947	51 091	42 460	39
112	16 752	15 754	5 003	5 076	35 522	42 706	122
0	7 837	116	9 331	3 646	26 063	6 368	0
603	454 635	526 460	0	0	0	0	0
0	2 056	13 377	2 321	6 948	4 086	243	0
27	69 677	39 998	165 342	31 883	102 125	11 602	11
0	0	0	0	0	17	0	0
11 001	4 937 232	3 936 673	5 610 092	7 759 364	2 481 903	2 836 761	6 842
(73)	(160 788)	(75 424)	(236 948)	(62 775)	(313 285)	(205 022)	(215)
0	(82 152)	(262 976)	0	0	0	0	0
0	(557 164)	(13 658)	(21 731)	(15 149)	(28 070)	(56 769)	0
(1 000)	(607 223)	(272 055)	0	0	0	0	0
0	(600)	(1 936)	(13 813)	(10 657)	(665)	(605)	0
(6)	(2 772)	(2 657)	(5 575)	(8 203)	(1 496)	(1 725)	(4)
0	(2 164)	(4 539)	(17 828)	0	(85 313)	(374 743)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	(68)	(203)	(33)	(44)	(206)	(129)	(2)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	(680)	(1 313)	0	0	0	0	0
(68)	(28 530)	0	(115 772)	0	(83 123)	0	(12)
0	(11 490)	(23 915)	(83 222)	(26 586)	(50 077)	(46 639)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(1 147)	(1 453 631)	(658 676)	(494 922)	(123 414)	(562 235)	(685 632)	(233)
$ 9 854	$ 3 483 601	$ 3 277 997	€ 5 115 170	€ 7 635 950	$ 1 919 668	$ 2 151 129	$ 6 609

Bilan (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Emerging Markets Bond Fund		Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	
	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	$ 3 267 661	$ 4 300 367	$ 2 422 256	$ 2 704 270
Fonds d'investissement	52 797	460 982	0	0
Contrats de mise en pension	9 160	50 323	44 661	51 143
Dépôts auprès d'établissements de crédit	2 227	0	1 659	0
Instruments financiers dérivés	69 071	44 804	56 599	25 463
Liquidités	4 943	5 545	2 605	1 402
Dépôts auprès de contreparties	49 025	22 985	25 425	12 338
Produits à recevoir	52 462	63 715	37 299	36 117
À recevoir sur investissements vendus	400	0	215	4 033
À recevoir sur investissements vendus TBA	26 106	55 110	4 814	6 793
À recevoir sur actions du Fonds vendues	714	7 831	10 705	4 975
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	25 590	10 646	10 516	0
Autres actifs	0	0	0	0
Total de l'actif à court terme	3 560 156	5 022 308	2 616 754	2 846 534
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(49 305)	(32 650)	(23 713)	(14 555)
Juste valeur des titres vendus à découvert	0	0	0	0
À payer sur investissements achetés	(10 331)	0	(3 745)	(2 662)
À payer sur investissements achetés TBA	(49 405)	(82 661)	(7 710)	(10 194)
À payer sur actions du Fonds rachetées	(13 371)	(4 978)	(461)	(1 632)
Frais de gestion à payer	(2 521)	(3 579)	(1 929)	(2 040)
À payer sur contrats de prise en pension	(75 356)	(166 230)	(38 840)	(167 203)
À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	0	0	0	0
Charges à payer	(12)	(20)	(1)	(1)
Découvert bancaire	0	0	0	0
Dividendes à payer	(276)	(491)	(2 167)	(1 172)
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(15 372)	0	(9 012)	(676)
Dépôts des contreparties	(38 228)	(16 955)	(36 701)	(10 630)
Autres passifs	0	0	0	0
Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	(254 177)	(307 564)	(124 279)	(210 765)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	$ 3 305 979	$ 4 714 744	$ 2 492 475	$ 2 635 769

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

Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund		Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		Fonds PIMCO ESG Income Fund	
Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
$ 143 387	$ 197 661	$ 181 600	$ 265 258	$ 15 264	$ 25 575	$ 254 108	$ 122 326
16 518	10 650	14 797	15 188	2 058	2 833	0	0
8 386	487	706	688	2 766	193	44 400	0
0	0	137	0	78	0	0	0
4 439	2 001	34 841	20 931	4 060	2 859	5 555	1 702
262	143	1 447	1 439	185	122	1 533	1 265
1 839	1 115	10 495	5 253	282	302	2 737	2 030
1 915	2 304	1 549	2 910	87	280	1 372	720
1	0	207	0	1	0	80	0
1 285	0	0	0	0	0	78 252	906
55	64	0	80	11	10	221	141
984	563	5 129	1 119	254	0	4 814	0
0	0	0	0	0	0	0	0
179 071	214 988	250 908	312 866	25 046	32 174	393 072	129 090
(618)	(756)	(31 528)	(16 321)	(3 067)	(2 339)	(4 277)	(432)
0	0	0	0	0	0	(2 630)	(204)
(2 163)	0	0	0	(109)	0	(707)	0
(2 563)	0	0	0	0	0	(141 114)	(1 202)
(10)	(20)	(586)	0	(5)	0	(12)	(1 453)
(172)	(228)	(64)	(233)	(25)	(36)	(118)	(66)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(8)	(7)	(1)	(1)	(12)	(2)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	(1)	(1)
(1 872)	0	(10 037)	0	(631)	(28)	(3 190)	(173)
(2 687)	(1 090)	(3 554)	(5 830)	(271)	(10)	(3 050)	(470)
0	0	0	0	0	0	0	0
(10 085)	(2 094)	(45 777)	(22 391)	(4 109)	(2 414)	(155 111)	(4 003)
$ 168 986	$ 212 894	$ 205 131	$ 290 475	$ 20 937	$ 29 760	$ 237 961	$ 125 087

Bilan (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Euro Bond Fund		Fonds Euro Credit Fund	
	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	€ 1 747 790	€ 2 354 423	€ 491 678	€ 902 376
Fonds d'investissement	181 654	167 438	50 689	63 657
Contrats de mise en pension	11 515	24 716	44 621	5 883
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	0	0
Instruments financiers dérivés	49 805	20 616	9 083	5 333
Liquidités	3 052	13 039	12 028	3 625
Dépôts auprès de contreparties	59 589	28 439	26 366	34 520
Produits à recevoir	8 903	10 706	4 187	7 125
À recevoir sur investissements vendus	13 467	41	2 447	12
À recevoir sur investissements vendus TBA	168 280	3 821	1 073	0
À recevoir sur actions du Fonds vendues	932	629	242	106
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	105 486	25 994	33 489	3 868
Autres actifs	0	0	0	0
Total de l'actif à court terme	2 350 473	2 649 862	675 903	1 026 505
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(122 819)	(53 814)	(13 081)	(6 300)
Juste valeur des titres vendus à découvert	0	0	0	0
À payer sur investissements achetés	(95)	(9 696)	(7 404)	0
À payer sur investissements achetés TBA	(264 938)	(5 728)	(13 488)	0
À payer sur actions du Fonds rachetées	(405)	(1 665)	(85)	(997)
Frais de gestion à payer	(807)	(1 121)	(252)	(385)
À payer sur contrats de prise en pension	0	0	0	0
À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	0	0	0	0
Charges à payer	(5)	(8)	0	0
Découvert bancaire	0	0	0	0
Dividendes à payer	0	0	0	0
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(41 188)	0	(29 619)	0
Dépôts des contreparties	(6 941)	(3 701)	(1 966)	(1 660)
Autres passifs	0	0	0	0
Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	(437 198)	(75 733)	(65 895)	(9 342)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	€ 1 913 275	€ 2 574 129	€ 610 008	€ 1 017 163

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

	Fonds Euro Income Bond Fund		Fonds Euro Long Average Duration Fund		Fonds Euro Short-Term Fund		Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	
	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
€	1 100 441	€ 2 206 773	€ 103 959	€ 155 866	€ 330 698	€ 595 961	€ 157 222	€ 154 011
	134 815	176 868	4 940	407	0	0	8 700	9 575
	120 458	7 551	1 500	1 236	14 100	26 537	3 700	4 900
	0	0	0	0	0	0	0	0
	26 003	20 260	3 789	1 769	5 409	1 689	2 007	463
	7 361	20 033	397	453	896	890	3 440	1 054
	47 460	64 074	4 382	2 569	6 396	4 891	2 986	897
	8 869	20 309	1 039	971	1 735	3 177	1 897	1 789
	53 521	63	0	7	63	0	32	12
	117 074	0	6 332	364	0	4 006	0	0
	1 107	1 051	51	0	550	610	71	0
	19 325	0	16 625	3 931	5 754	108	1 485	0
	0	0	0	0	0	0	0	0
	1 636 434	2 516 982	143 014	167 573	365 601	637 869	181 540	172 701
	(27 457)	(3 673)	(18 830)	(6 131)	(2 312)	(2 318)	(1 105)	(400)
	0	0	0	0	0	0	0	0
	(22 578)	(4 987)	0	(111)	0	(706)	(4 181)	(1 789)
	(208 728)	0	(11 721)	(546)	0	(4 004)	0	0
	(1 033)	(5 348)	0	0	(1 514)	(809)	(1)	(18)
	(1 244)	(2 119)	(46)	(64)	(105)	(170)	(13)	(3)
	0	(3 195)	0	0	0	0	0	0
	0	0	0	0	0	0	0	0
	(17)	(28)	0	0	0	0	0	0
	0	0	0	0	0	0	0	0
	0	0	0	0	0	0	0	0
	(18 036)	(7 677)	(2 369)	0	(6 452)	0	(2 078)	(1)
	(4 361)	(7 651)	0	(120)	(2 123)	(3)	0	(1)
	0	0	0	0	0	0	0	0
	(283 454)	(34 678)	(32 966)	(6 972)	(12 506)	(8 010)	(7 378)	(2 212)
€	1 352 980	€ 2 482 304	€ 110 048	€ 160 601	€ 353 095	€ 629 859	€ 174 162	€ 170 489

Bilan (suite)

(Montants en milliers)	Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Fonds Global Advantage Fund	
	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	€ 193 346	€ 351 206	$ 443 632	$ 587 365
Fonds d'investissement	18 800	26 155	18 242	18 823
Contrats de mise en pension	4 400	11 681	1 408	206
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	0	0
Instruments financiers dérivés	7 774	4 478	25 927	11 543
Liquidités	640	836	3 907	5 555
Dépôts auprès de contreparties	4 772	7 109	15 524	10 252
Produits à recevoir	1 077	1 510	2 702	2 915
À recevoir sur investissements vendus	1 622	1 896	9 551	8 317
À recevoir sur investissements vendus TBA	12 293	364	96 161	209 240
À recevoir sur actions du Fonds vendues	293	45	3	19
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	4 861	0	22 907	1 216
Autres actifs	0	0	0	0
Total de l'actif à court terme	249 878	405 280	639 964	855 451
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(8 310)	(7 549)	(21 316)	(10 288)
Juste valeur des titres vendus à découvert	0	0	(28 813)	(57 191)
À payer sur investissements achetés	(590)	0	(8 457)	(14 219)
À payer sur investissements achetés TBA	(23 393)	(546)	(140 479)	(212 883)
À payer sur actions du Fonds rachetées	(111)	(186)	(35)	(32)
Frais de gestion à payer	(66)	(120)	(250)	(316)
À payer sur contrats de prise en pension	0	(611)	(1 504)	(35 450)
À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	0	0	0	0
Charges à payer	0	0	(17)	(25)
Découvert bancaire	0	0	0	0
Dividendes à payer	0	0	0	0
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(5 044)	(750)	(23 802)	0
Dépôts des contreparties	(1 192)	(27)	(4 832)	(3 980)
Autres passifs	0	0	0	0
Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	(38 706)	(9 789)	(229 505)	(334 384)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	€ 211 172	€ 395 491	$ 410 459	$ 521 067

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

Fonds Global Bond Fund		Fonds Global Bond ESG Fund		Fonds Global Bond Ex-US Fund		Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	
Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
$ 11 361 097	$ 15 289 653	$ 2 913 880	$ 2 374 485	$ 737 412	$ 1 081 382	$ 473 435	$ 575 784
1 120 979	1 197 100	5 649	6 595	47 322	6 361	251 489	388 149
1 346 970	3 378	1 157 847	38 254	1 625	1 246	18 536	511
0	0	0	0	0	0	0	0
518 391	369 066	94 009	56 798	35 105	13 807	29 087	29 674
32 207	38 469	8 552	8 538	5 507	7 191	12 189	13 516
478 539	275 050	125 721	34 338	39 796	20 245	40 674	61 007
51 007	83 537	10 094	10 524	3 559	6 445	1 307	1 629
279 220	269 817	26 307	25 414	15 805	15 507	4 838	810
4 755 367	4 531 716	450 850	542 093	255 052	399 574	90 163	113 928
77 660	6 862	3 518	1 726	460	31	270	340
658 178	22 127	164 909	4 857	56 123	7 205	35 050	0
0	0	0	0	0	0	0	0
20 679 615	22 086 775	4 961 336	3 103 622	1 197 766	1 558 994	957 038	1 185 348
(859 558)	(368 266)	(151 501)	(39 219)	(63 177)	(22 778)	(43 855)	(9 866)
(721 316)	(1 368 631)	(119 122)	(197 580)	(76 200)	(150 627)	0	(84 769)
(930 760)	(268 606)	(622 586)	(33 767)	(15 641)	(24 164)	(1 870)	(5 707)
(6 231 107)	(4 789 961)	(792 022)	(504 380)	(282 153)	(334 379)	(117 381)	(29 309)
(13 836)	(17 323)	(10 843)	(764)	(75)	(4 342)	(10 695)	(323)
(5 736)	(7 214)	(1 314)	(972)	(342)	(443)	(793)	(1 027)
(1 682)	(1 166 988)	0	0	0	(99 506)	0	0
0	0	0	0	0	(8 467)	0	0
(137)	(164)	(3)	(5)	(7)	(11)	(3)	(3)
0	0	0	0	0	0	0	0
(736)	(866)	(399)	(291)	0	0	(40)	(58)
(407 767)	0	(125 388)	0	(41 421)	0	(18 837)	(12 600)
(86 868)	(59 910)	(31 968)	(23 678)	(2 728)	(2 570)	(13 488)	(6 665)
0	0	0	0	0	0	0	0
(9 259 503)	(8 047 929)	(1 855 146)	(800 656)	(481 744)	(647 287)	(206 962)	(150 327)
$ 11 420 112	$ 14 038 846	$ 3 106 190	$ 2 302 966	$ 716 022	$ 911 707	$ 750 076	$ 1 035 021

Bilan (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Global High Yield Bond Fund		Fonds Global Investment Grade Credit Fund	
	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	$ 2 850 786	$ 4 683 221	$ 9 778 544	$ 16 283 191
Fonds d'investissement	201 583	417 716	1 038 326	1 100 873
Contrats de mise en pension	11 412	0	75 423	4 429
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	0	0
Instruments financiers dérivés	36 885	38 557	212 298	191 914
Liquidités	26	1 537	20 756	50 691
Dépôts auprès de contreparties	28 611	21 314	275 295	279 019
Produits à recevoir	40 375	60 659	90 845	142 494
À recevoir sur investissements vendus	23	56	34 506	4 769
À recevoir sur investissements vendus TBA	0	0	1 919 603	1 041 946
À recevoir sur actions du Fonds vendues	7 615	9 087	30 854	9 657
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	788	5 436	180 542	100 355
Autres actifs	223	175	0	0
Total de l'actif à court terme	3 178 327	5 237 758	13 656 992	19 209 338
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(20 824)	(14 484)	(293 790)	(216 037)
Juste valeur des titres vendus à découvert	0	0	(136 255)	(224 962)
À payer sur investissements achetés	0	(44)	0	(9 522)
À payer sur investissements achetés TBA	0	0	(2 481 720)	(1 475 711)
À payer sur actions du Fonds rachetées	(13 817)	(4 927)	(32 381)	(21 164)
Frais de gestion à payer	(1 960)	(3 102)	(5 738)	(9 073)
À payer sur contrats de prise en pension	(10 397)	(15 872)	(4 154)	(7 380)
À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	0	0	0	0
Charges à payer	(123)	(139)	(339)	(553)
Découvert bancaire	0	0	0	0
Dividendes à payer	(4 126)	(7 729)	(6 988)	(16 246)
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(3 436)	0	(82 017)	0
Dépôts des contreparties	(20 776)	(22 301)	(75 269)	(73 765)
Autres passifs	0	0	0	0
Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	(75 459)	(68 598)	(3 118 651)	(2 054 413)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	$ 3 102 868	$ 5 169 160	$ 10 538 341	$ 17 154 925

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

Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund		Fonds Global Low Duration Real Return Fund		Fonds Global Real Return Fund		Fonds Income Fund	
Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
$ 1 489 771	$ 1 166 597	$ 1 661 693	$ 1 420 625	$ 3 391 396	$ 4 811 615	$ 67 246 471	$ 76 792 728
0	0	12 424	12 363	7 043	192	2 081 428	2 811 875
15 240	962	1 053	1 138	2 245	5 680	3 421 698	6 365 633
0	0	0	0	0	0	0	0
33 293	14 075	50 766	28 567	106 832	70 667	5 163 114	1 770 198
2 079	2 463	9 404	6 245	8 086	15 002	89 931	91 434
30 302	9 154	18 687	12 451	46 251	36 615	1 852 978	1 796 692
11 400	6 974	2 931	2 483	7 667	6 926	354 824	384 924
52 816	120	94 773	68	68 378	402	60 282	65 747
135 728	0	72 965	13 920	191 920	60 107	21 347 671	17 819 516
1 945	2 814	574	7 839	4 737	12 767	88 371	223 885
13 422	1 482	12 290	1 281	27 734	0	1 235 828	0
0	0	0	0	0	0	236	0
1 785 996	1 204 641	1 937 560	1 506 980	3 862 289	5 019 973	102 942 832	108 122 632
(17 969)	(5 914)	(29 733)	(20 118)	(93 426)	(53 145)	(3 649 860)	(725 980)
(5 887)	0	0	0	0	(311)	(734 103)	(484 196)
(8 117)	(1 129)	(30 524)	0	0	0	(205 883)	(3 521 764)
(202 456)	0	(132 585)	(27 180)	(325 573)	(116 048)	(37 310 306)	(28 452 770)
(188)	(411)	(2 607)	(94)	(3 628)	(3 514)	(145 081)	(98 350)
(605)	(468)	(735)	(633)	(1 447)	(2 039)	(45 253)	(56 822)
(75 928)	0	(261 713)	0	(796 152)	(772 701)	(15 867)	(73 072)
(75 925)	0	(79 599)	(250 806)	(9 519)	(335 849)	0	0
(124)	(80)	(2)	(2)	(51)	(77)	(4 925)	(4 993)
0	0	0	0	0	0	0	0
(692)	(806)	(446)	(590)	(2 363)	(2 837)	(2 737)	(2 008)
(13 852)	0	(18 182)	0	(35 345)	(4 981)	(2 473 835)	(789 779)
(14 363)	(6 270)	(17 059)	(8 481)	(22 923)	(25 092)	(374 655)	(333 172)
0	0	0	0	0	0	0	0
(416 106)	(15 078)	(573 185)	(307 904)	(1 290 427)	(1 316 594)	(44 962 505)	(34 542 906)
$ 1 369 890	$ 1 189 563	$ 1 364 375	$ 1 199 076	$ 2 571 862	$ 3 703 379	$ 57 980 327	$ 73 579 726

Bilan (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Income Fund II		Fonds Inflation Multi-Asset Fund[1]	
	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	$ 56 970	$ 26 514	$ 320 121	$ 142 619
Fonds d'investissement	1 740	2 701	68 975	20 447
Contrats de mise en pension	0	0	40 720	500
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	0	0
Instruments financiers dérivés	718	138	14 716	4 126
Liquidités	644	507	0	958
Dépôts auprès de contreparties	1 022	155	8 179	2 360
Produits à recevoir	384	155	688	236
À recevoir sur investissements vendus	5	1	13	779
À recevoir sur investissements vendus TBA	8 075	3 539	10 546	8 837
À recevoir sur actions du Fonds vendues	4 020	0	100	1 262
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	637	0	7 201	1 707
Autres actifs	0	49	0	0
Total de l'actif à court terme	74 215	33 759	471 259	183 831
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(406)	(87)	(10 695)	(3 745)
Juste valeur des titres vendus à découvert	0	0	0	0
À payer sur investissements achetés	(182)	(204)	(2 206)	(284)
À payer sur investissements achetés TBA	(15 917)	(5 616)	(43 111)	(13 222)
À payer sur actions du Fonds rachetées	0	0	(1 769)	(99)
Frais de gestion à payer	(48)	(15)	(445)	(176)
À payer sur contrats de prise en pension	0	0	0	0
À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	0	0	0	0
Charges à payer	0	(50)	(5)	0
Découvert bancaire	0	0	(980)	0
Dividendes à payer	0	0	0	0
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(1 036)	(17)	(6 644)	0
Dépôts des contreparties	0	0	(2 326)	(1 960)
Autres passifs	(3)	0	0	0
Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	(17 592)	(5 989)	(68 181)	(19 486)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	$ 56 623	$ 27 770	$ 403 078	$ 164 345

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

(1) Le 13 avril 2022, le Fonds Inflation Strategy Fund a pris le nom de Fonds Inflation Multi-Asset Fund.

(2) Le 1er juillet 2022, le Fonds Global LIBOR Plus Bond Fund a pris le nom de Fonds Low Duration Opportunities Fund.

	Fonds Low Average Duration Fund		Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Fonds Low Duration Income Fund		Fonds Low Duration Opportunities Fund[2]	
	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	$ 1 235 606	$ 1 057 626	$ 691 422	$ 734 742	$ 1 213 608	$ 1 446 972	$ 1 216 746	$ 2 786 796
	85 631	113 421	643	78 479	106 140	132 416	133 056	312 142
	956	24 177	1 604	892	98 831	7 961	118 800	72 663
	0	0	0	0	0	0	0	0
	7 284	2 332	13 518	8 643	79 359	23 761	55 664	71 141
	2 692	2 927	390	1 433	6 374	5 269	3 357	6 686
	24 403	8 182	10 136	9 961	34 272	28 872	57 806	29 781
	6 394	2 367	5 082	4 266	7 264	7 379	7 718	13 094
	723	23	202	3	2 215	766	12 795	60
	380 707	193 244	69 997	71 010	367 632	252 242	282 511	507 359
	976	602	2 763	443	2 070	3 175	542	3 583
	7 914	4 218	11 170	2 906	21 540	0	45 871	23 070
	0	0	0	0	0	0	0	0
	1 753 286	1 409 119	806 927	912 778	1 939 305	1 908 813	1 934 866	3 826 375
	(14 403)	(5 784)	(11 395)	(5 547)	(64 082)	(12 736)	(109 833)	(49 450)
	(76 949)	(38 058)	(14 029)	(15 770)	(5 209)	(213)	(94 108)	(253 414)
	(2 924)	0	(1 062)	0	(9 219)	(14 668)	(12 575)	(3 929)
	(427 587)	(183 803)	(97 540)	(76 434)	(724 143)	(501 622)	(347 541)	(261 219)
	(1 987)	(477)	(422)	(621)	(185)	(176)	(139)	(491)
	(495)	(527)	(289)	(350)	(565)	(661)	(542)	(1 274)
	(144 857)	0	(12 776)	0	0	0	0	(1 088)
	(4 077)	0	(1 409)	(2 682)	0	0	0	0
	(10)	(13)	0	0	(24)	(26)	(8)	(4)
	0	0	0	0	0	0	0	0
	(13)	(7)	(20)	(65)	(247)	(370)	(1 377)	(1 545)
	(3 315)	0	(4 014)	0	(28 430)	(288)	(19 443)	0
	(3 911)	(1 312)	(9 222)	(4 440)	(22 821)	(10 578)	(3 519)	(36 701)
	0	0	0	0	0	0	0	0
	(680 528)	(229 981)	(152 178)	(105 909)	(854 925)	(541 338)	(589 085)	(609 115)
	$ 1 072 758	$ 1 179 138	$ 654 749	$ 806 869	$ 1 084 380	$ 1 367 475	$ 1 345 781	$ 3 217 260

Bilan (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund[1] Au 31 décembre 2022	Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Actif à court terme :			
Actif financier à la juste valeur par résultat :			
Valeurs mobilières	$ 5 070	$ 106 959	$ 91 234
Fonds d'investissement	0	11 833	9 531
Contrats de mise en pension	0	811	0
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	0
Instruments financiers dérivés	22	1 447	602
Liquidités	122	552	128
Dépôts auprès de contreparties	31	2 870	0
Produits à recevoir	16	104	62
À recevoir sur investissements vendus	0	13	2 074
À recevoir sur investissements vendus TBA	274	0	0
À recevoir sur actions du Fonds vendues	0	59	400
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	51	0	0
Autres actifs	0	0	274
Total de l'actif à court terme	5 586	124 648	104 305
Passif à court terme :			
Passif financier à la juste valeur par résultat :			
Instruments financiers dérivés	(67)	(237)	(207)
Juste valeur des titres vendus à découvert	0	0	0
À payer sur investissements achetés	0	(2 379)	(2 114)
À payer sur investissements achetés TBA	(545)	0	0
À payer sur actions du Fonds rachetées	0	(834)	(23)
Frais de gestion à payer	(2)	(109)	(83)
À payer sur contrats de prise en pension	0	0	0
À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	0	0	0
Charges à payer	0	0	0
Découvert bancaire	0	0	0
Dividendes à payer	0	0	0
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(44)	0	0
Dépôts des contreparties	0	(952)	(1 340)
Autres passifs	0	0	0
Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	(658)	(4 511)	(3 767)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	$ 4 928	$ 120 137	$ 100 538

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

[1] Le Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund a été lancé le 27 juillet 2022.

Fonds Mortgage Opportunities Fund		Fonds StocksPLUS™ Fund		Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Fonds Strategic Income Fund	
Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
$ 1 724 999	$ 2 954 598	$ 711 694	$ 2 342 626	$ 7 750	$ 9 467	$ 610 560	$ 758 311
23	93 049	92 742	342 388	904	1 103	29 661	15 171
17 318	2 125	156 445	1 471 512	1 374	1 432	781	476
0	0	0	0	0	0	0	0
44 003	52 801	12 661	110 152	258	305	53 205	12 361
167	2 246	2 178	1 676	11	35	4 623	5 076
11 602	31 320	85 945	119 116	861	231	11 922	15 351
4 660	5 923	2 660	4 915	21	16	2 787	3 698
1 901	165	255	49 250	0	649	4 738	345
1 781 393	1 981 607	0	0	1 240	1 357	224 967	279 954
412	8 485	1 226	8 655	0	0	385	824
17 755	0	33 144	0	115	39	14 864	4 458
0	0	0	0	0	0	0	0
3 604 233	5 132 319	1 098 950	4 450 290	12 534	14 634	958 493	1 096 025
(17 225)	(15 508)	(30 319)	(40 872)	(293)	(110)	(36 766)	(12 272)
(518 212)	(640 730)	0	0	(583)	(305)	(13 092)	(32 833)
(194 452)	(577)	(37 060)	(500 740)	(583)	0	(741)	(9 686)
(1 654 287)	(1 834 460)	0	0	(1 310)	(1 802)	(367 853)	(413 907)
(596)	(87)	(1 097)	(10 062)	0	0	(539)	(570)
(547)	(942)	(656)	(1 891)	(6)	(7)	(585)	(706)
(316 493)	(363 919)	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	(1 841)
(8)	(18)	(5)	(7)	0	0	(17)	(12)
0	0	0	0	0	0	0	0
(21)	(18)	0	0	0	0	0	0
(18 210)	(21 268)	(15 583)	(23 105)	(231)	0	(21 409)	0
(35 034)	(16 368)	(5 491)	(112 457)	0	(800)	(10 934)	(4 270)
0	0	0	0	0	0	0	0
(2 755 085)	(2 893 895)	(90 211)	(689 134)	(3 006)	(3 024)	(451 936)	(476 097)
$ 849 148	$ 2 238 424	$ 1 008 739	$ 3 761 156	$ 9 528	$ 11 610	$ 506 557	$ 619 928

Bilan (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Total Return Bond Fund		Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	
	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	$ 4 770 861	$ 5 405 196	$ 335 879	$ 87 130
Fonds d'investissement	292 421	423 494	41 693	4 572
Contrats de mise en pension	170 895	7 152	27 452	800
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	600	0
Instruments financiers dérivés	110 789	54 310	42 556	12 654
Liquidités	15 733	19 769	3 994	1 523
Dépôts auprès de contreparties	120 293	91 011	28 858	8 749
Produits à recevoir	25 541	23 708	1 601	77
À recevoir sur investissements vendus	51 883	7	134	4
À recevoir sur investissements vendus TBA	2 180 028	800 505	25 221	0
À recevoir sur actions du Fonds vendues	12 045	859	11 015	42
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	77 114	0	17 270	0
Autres actifs	0	0	0	0
Total de l'actif à court terme	7 827 603	6 826 011	536 273	115 551
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(106 644)	(52 693)	(44 109)	(7 768)
Juste valeur des titres vendus à découvert	(68 457)	0	0	0
À payer sur investissements achetés	(6 344)	(1)	(523)	(21)
À payer sur investissements achetés TBA	(3 304 650)	(1 565 309)	(30 301)	0
À payer sur actions du Fonds rachetées	(3 734)	(12 407)	(3 552)	0
Frais de gestion à payer	(2 652)	(3 292)	(453)	(121)
À payer sur contrats de prise en pension	(1 745)	(225 851)	0	0
À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	(76 810)	0	0	0
Charges à payer	(210)	(205)	0	0
Découvert bancaire	0	0	0	0
Dividendes à payer	(186)	(241)	(317)	0
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(72 167)	(16 432)	(16 064)	(5 102)
Dépôts des contreparties	(33 287)	(4 682)	(5 030)	(750)
Autres passifs	0	0	0	0
Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	(3 676 886)	(1 881 113)	(100 349)	(13 762)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	$ 4 150 717	$ 4 944 898	$ 435 924	$ 101 789

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

	Fonds UK Corporate Bond Fund		Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund		Fonds US High Yield Bond Fund		Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	
	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	£ 372 745	£ 571 865	£ 309 110	£ 403 042	$ 1 895 465	$ 3 607 920	$ 346 399	$ 881 526
	5 370	208	0	0	39 162	255 818	38 657	6 571
	177	526	269	442	9 269	1 473	15 383	686
	0	0	0	0	0	0	0	0
	4 161	1 924	8 017	4 147	12 684	9 373	8 390	13 601
	1 084	4 094	0	4 588	550	291	796	2 568
	7 199	9 544	14 086	12 076	10 449	12 192	12 615	16 731
	4 405	5 804	4 594	4 416	31 884	53 960	3 400	7 911
	1 522	333	0	43	3 204	1 958	27 549	5
	0	0	0	0	0	0	21 983	25 425
	61	1 701	0	0	1 390	1 806	2 561	41
	7 000	2 540	15 391	0	270	2 079	5 621	2 575
	0	0	0	0	186	137	0	0
	403 724	598 539	351 467	428 754	2 004 513	3 947 007	483 354	957 640
	(1 718)	(2 838)	(3 697)	(1 533)	(1 517)	(1 240)	(7 500)	(5 861)
	0	0	0	0	0	0	(2 035)	(3 780)
	0	(803)	0	(47)	(4 262)	(12 576)	0	(998)
	0	0	0	0	0	0	(39 829)	(34 064)
	(70)	(116)	0	0	(2 743)	(1 122)	(58)	(58)
	(127)	(198)	(131)	(168)	(1 173)	(2 175)	(182)	(384)
	0	(513)	0	(513)	0	0	0	0
	0	0	0	0	0	0	(38 655)	(26 510)
	0	0	0	(1)	(148)	(204)	0	0
	0	0	(2 154)	0	0	0	0	0
	(1 865)	(1 718)	(371)	(332)	(20)	(84)	(156)	(325)
	(10 440)	0	(19 583)	(264)	(1 779)	0	(4 541)	0
	(331)	(189)	(511)	(148)	(7 949)	(5 820)	(1 876)	(7 560)
	0	0	0	0	0	0	0	0
	(14 551)	(6 375)	(26 447)	(3 006)	(19 591)	(23 221)	(94 832)	(79 540)
	£ 389 173	£ 592 164	£ 325 020	£ 425 748	$ 1 984 922	$ 3 923 786	$ 388 522	$ 878 100

Bilan (suite)

(Montants en milliers)	Fonds US Short-Term Fund		Total Société*	
	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Actif à court terme :				
Actif financier à la juste valeur par résultat :				
Valeurs mobilières	$ 1 891 711	$ 2 807 383	$ 158 067 452	$ 208 816 756
Fonds d'investissement	226 018	269 578	7 205 963	10 683 404
Contrats de mise en pension	154 472	1 571	10 455 165	8 915 653
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	11 759	0
Instruments financiers dérivés	10 584	4 662	8 087 908	3 900 473
Liquidités	1 993	2 849	369 095	477 055
Dépôts auprès de contreparties	18 130	19 585	4 738 366	4 042 726
Produits à recevoir	12 016	8 627	1 097 303	1 382 643
À recevoir sur investissements vendus	4 313	997	1 035 370	468 689
À recevoir sur investissements vendus TBA	0	0	36 037 151	29 486 811
À recevoir sur actions du Fonds vendues	6 106	383	405 829	373 677
À recevoir sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	5 389	9 832	3 520 113	338 656
Autres actifs	0	0	662	635
Total de l'actif à court terme	2 330 732	3 125 467	231 032 136	268 887 178
Passif à court terme :				
Passif financier à la juste valeur par résultat :				
Instruments financiers dérivés	(5 824)	(16 054)	(7 088 064)	(2 398 130)
Juste valeur des titres vendus à découvert	0	0	(2 699 152)	(3 816 550)
À payer sur investissements achetés	(1 430)	(531)	(3 353 495)	(4 750 126)
À payer sur investissements achetés TBA	0	0	(57 317 614)	(41 265 351)
À payer sur actions du Fonds rachetées	(2 669)	(3 131)	(417 932)	(233 829)
Frais de gestion à payer	(722)	(770)	(108 234)	(146 545)
À payer sur contrats de prise en pension	0	(215 091)	(2 874 391)	(3 878 191)
À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	0	(237 755)	(303 953)	(944 710)
Charges à payer	(4)	(7)	(7 630)	(4 687)
Découvert bancaire	0	0	(20 563)	0
Dividendes à payer	0	0	(30 796)	(48 748)
À payer sur dépôts de garantie d'instruments financiers dérivés	(4 603)	0	(4 103 581)	(934 871)
Dépôts des contreparties	(5 365)	(1 930)	(1 182 210)	(1 122 642)
Autres passifs	0	0	(3)	0
Total du passif à court terme hors actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	(20 617)	(475 269)	(79 507 617)	(59 544 380)
Actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables	$ 2 310 115	$ 2 650 198	$ 151 524 519	$ 209 342 798

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

* Le Total Société au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 a été ajusté pour éliminer des investissements croisés et des soldes au nom de la Société. Veuillez vous reporter à la Note 14 des Notes relatives aux États financiers pour plus de détails sur les investissements croisés.

Au nom du Conseil d'administration :

Administrateur : Craig A. Dawson

Administrateur : David M. Kennedy

Date : 25 avril 2023

(Cette page est laissée vierge volontairement)

Compte de résultat

(Montants en milliers)	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Produits				
Produits des intérêts et dividendes	$ 215 235	$ 119 728	$ 15 190	$ 11 211
Autres produits	0	0	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(437 831)	(54 488)	(25 277)	(2 299)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	(75 534)	(32 648)	(12 295)	(7 916)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	333	(439)	152	126
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(288 652)	(334 955)	(26 718)	(20 528)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	15 038	13 399	2 022	767
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	(22)	(33)	0	(3)
Total des revenus/(pertes) sur investissements	(571 433)	(289 436)	(46 926)	(18 642)
Charges d'exploitation				
Frais de gestion	(19 675)	(13 097)	(1 966)	(1 554)
Frais de services	(570)	(885)	0	0
Frais de commercialisation	(167)	(211)	0	0
Autres charges	(3)	(9)	0	0
Total des charges	(20 415)	(14 202)	(1 966)	(1 554)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	17	17	4	4
Charges d'exploitation nettes	(20 398)	(14 185)	(1 962)	(1 550)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	(591 831)	(303 621)	(48 888)	(20 192)
Frais financiers				
Frais des intérêts	(165)	0	(17)	0
Frais de facilité de crédit	0	0	0	0
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	(42 838)	(34 319)	(7 980)	(5 451)
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	(557)	1 785	(49)	571
Total des frais financiers	(43 560)	(32 534)	(8 046)	(4 880)
Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt	(635 391)	(336 155)	(56 934)	(25 072)
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	23	(146)	3	(30)
Impôt sur les plus-values	0	(5)	0	1
Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt	(635 368)	(336 306)	(56 931)	(25 101)
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	$ (635 368)	$ (336 306)	$ (56 931)	$ (25 101)

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

Fonds PIMCO Capital Securities Fund		Fonds PIMCO Climate Bond Fund		Fonds Commodity Real Return Fund		Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
$ 321 673	$ 349 919	$ 6 811	$ 3 914	$ 118 558	$ 37 235	$ 4 895	$ 5 261
0	0	0	0	0	0	0	0
(339 637)	214 686	(21 894)	(693)	(70 911)	3 321	(5 524)	3 351
281 327	84 747	(3 655)	(13 640)	302 706	109 320	(2 140)	(2 961)
(92 745)	(43 553)	(3)	(928)	(8 645)	3 489	(53)	(7)
(1 370 283)	(465 338)	(49 332)	(9 793)	(183 928)	(24 168)	(9 050)	(7 074)
9 513	29 115	(1 924)	4 118	(59 310)	47 720	350	(1 617)
473	38 100	35	(19)	701	(40)	(9)	19
(1 189 679)	207 676	(69 962)	(17 041)	99 171	176 877	(11 531)	(3 028)
(63 252)	(84 848)	(1 683)	(1 460)	(18 878)	(10 222)	(1 271)	(1 511)
(1 606)	(2 208)	(9)	(1)	(252)	(159)	0	0
(1 243)	(1 687)	0	0	0	0	0	0
(656)	(842)	(15)	(10)	(2)	(1)	(3)	(4)
(66 757)	(89 585)	(1 707)	(1 471)	(19 132)	(10 382)	(1 274)	(1 515)
302	2 370	0	0	0	0	1	1
(66 455)	(87 215)	(1 707)	(1 471)	(19 132)	(10 382)	(1 273)	(1 514)
(1 256 134)	120 461	(71 669)	(18 512)	80 039	166 495	(12 804)	(4 542)
(10 267)	(2 046)	(6)	(13)	(6 180)	(57)	(155)	(56)
0	0	0	0	0	0	0	0
(84 957)	(82 677)	(2 206)	(961)	(336)	0	0	0
(2 829)	1 719	40	(72)	41	0	0	0
(98 053)	(83 004)	(2 172)	(1 046)	(6 475)	(57)	(155)	(56)
(1 354 187)	37 457	(73 841)	(19 558)	73 564	166 438	(12 959)	(4 598)
(609)	(961)	3	(6)	0	(2)	5	(9)
0	0	0	0	0	0	0	0
(1 354 796)	36 496	(73 838)	(19 564)	73 564	166 436	(12 954)	(4 607)
$ (1 354 796)	$ 36 496	$ (73 838)	$ (19 564)	$ 73 564	$ 166 436	$ (12 954)	$ (4 607)

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Diversified Income Fund		Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Produits				
Produits des intérêts et dividendes	$ 423 503	$ 569 476	$ 32 188	$ 50 014
Autres produits	0	0	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(732 205)	164 764	(78 712)	25 312
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	(1 031 422)	(60 829)	(20 394)	(2 784)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	(127 348)	(75 567)	(3 436)	1 763
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(1 569 253)	(960 696)	(92 998)	(87 262)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	(137 498)	(177 480)	(15 985)	5 204
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	(2 364)	5 769	(189)	32
Total des revenus/(pertes) sur investissements	(3 176 587)	(534 563)	(179 526)	(7 721)
Charges d'exploitation				
Frais de gestion	(117 086)	(192 927)	(7 323)	(13 779)
Frais de services	(575)	(721)	(27)	(49)
Frais de commercialisation	(945)	(1 383)	0	0
Autres charges	(488)	(663)	(11)	(7)
Total des charges	(119 094)	(195 694)	(7 361)	(13 835)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	1 707	3 244	94	266
Charges d'exploitation nettes	(117 387)	(192 450)	(7 267)	(13 569)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	(3 293 974)	(727 013)	(186 793)	(21 290)
Frais financiers				
Frais des intérêts	(520)	(91)	(82)	(11)
Frais de facilité de crédit	0	0	0	0
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	(139 762)	(191 274)	(9 289)	(12 331)
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	(5 667)	(2 570)	(645)	(71)
Total des frais financiers	(145 949)	(193 935)	(10 016)	(12 413)
Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt	(3 439 923)	(920 948)	(196 809)	(33 703)
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	175	(159)	12	(11)
Impôt sur les plus-values	0	0	0	0
Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt	(3 439 748)	(921 107)	(196 797)	(33 714)
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	$ (3 439 748)	$ (921 107)	$ (196 797)	$ (33 714)

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

Fonds Diversified Income ESG Fund	Fonds Dynamic Bond Fund		Fonds Dynamic Multi-Asset Fund		Fonds Emerging Local Bond Fund		Fonds Emerging Local Bond ESG Fund
Période du 27 juil. 2022 au 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Période du 27 juil. 2022 au 31 déc. 2022
$ 226	$ 97 066	$ 89 693	€ 54 199	€ 41 589	$ 110 813	$ 150 390	$ 151
0	0	0	0	0	0	0	0
12	(49 022)	51 206	(10 017)	410 924	(295 703)	(75 996)	4
(135)	(160 148)	(60 484)	(164 295)	(242 369)	64 889	31 014	73
15	(14 875)	6 100	21 614	(5 876)	(13 501)	(9 225)	(13)
(176)	(262 668)	(143 628)	(805 632)	(36 545)	18 064	(225 952)	151
(13)	(63 001)	(12 734)	5 000	(40 357)	(19 913)	(79 723)	62
2	(254)	337	(7 889)	(267)	488	23 074	1
(69)	(452 902)	(69 510)	(907 020)	127 099	(134 863)	(186 418)	429
(30)	(29 354)	(34 662)	(78 669)	(92 725)	(18 109)	(24 923)	(20)
0	(197)	(234)	(38)	(34)	(95)	(112)	0
0	(178)	(242)	0	0	0	0	0
0	(147)	(166)	(395)	(446)	(3)	(3)	0
(30)	(29 876)	(35 304)	(79 102)	(93 205)	(18 207)	(25 038)	(20)
0	462	472	1 243	1 272	0	46	0
(30)	(29 414)	(34 832)	(77 859)	(91 933)	(18 207)	(24 992)	(20)
(99)	(482 316)	(104 342)	(984 879)	35 166	(153 070)	(211 410)	409
0	(482)	(64)	(354)	(3 102)	(6 817)	(7 947)	0
0	0	0	0	0	0	0	0
0	(7 206)	(9 091)	(6 983)	(9 431)	(11 526)	(18 810)	(1)
0	(584)	210	555	(178)	95	(890)	0
0	(8 272)	(8 945)	(6 782)	(12 711)	(18 248)	(27 647)	(1)
(99)	(490 588)	(113 287)	(991 661)	22 455	(171 318)	(239 057)	408
(1)	12	(84)	(10 191)	(5 882)	(681)	(1 142)	(4)
0	(41)	0	0	0	(201)	717	(2)
(100)	(490 617)	(113 371)	(1 001 852)	16 573	(172 200)	(239 482)	402
$ (100)	$ (490 617)	$ (113 371)	€ (1 001 852)	€ 16 573	$ (172 200)	$ (239 482)	$ 402

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Emerging Markets Bond Fund		Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Produits				
Produits des intérêts et dividendes	$ 190 399	$ 246 715	$ 120 478	$ 103 739
Autres produits	0	0	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(411 715)	42 422	(132 949)	11 849
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	(197 333)	(146 684)	(169 322)	(112 702)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	(5 189)	(2 177)	(2 769)	(1 185)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(486 975)	(369 547)	(496 113)	(172 069)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	6 524	(25 567)	23 079	2 768
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	(79)	(182)	(644)	572
Total des revenus/(pertes) sur investissements	(904 368)	(255 020)	(658 240)	(167 028)
Charges d'exploitation				
Frais de gestion	(31 503)	(45 749)	(21 416)	(20 619)
Frais de services	(30)	(42)	(8)	(7)
Frais de commercialisation	(146)	(183)	(6)	(7)
Autres charges	(5)	(5)	(3)	(2)
Total des charges	(31 684)	(45 979)	(21 433)	(20 635)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	0	0	0	0
Charges d'exploitation nettes	(31 684)	(45 979)	(21 433)	(20 635)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	(936 052)	(300 999)	(679 673)	(187 663)
Frais financiers				
Frais des intérêts	(2 019)	(863)	(719)	(851)
Frais de facilité de crédit	0	0	0	0
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	(45 471)	(62 778)	(28 379)	(21 696)
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	(690)	2 438	482	3 785
Total des frais financiers	(48 180)	(61 203)	(28 616)	(18 762)
Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt	(984 232)	(362 202)	(708 289)	(206 425)
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	(171)	(873)	24	(172)
Impôt sur les plus-values	0	0	0	0
Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt	(984 403)	(363 075)	(708 265)	(206 597)
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	$ (984 403)	$ (363 075)	$ (708 265)	$ (206 597)

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

Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund		Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		Fonds PIMCO ESG Income Fund	
Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Période du 29 avr. 2021 au 31 déc. 2021
$ 7 612	$ 10 278	$ 9 073	$ 11 487	$ 630	$ 749	$ 4 921	$ 908
0	0	0	0	0	0	0	0
(10 629)	(28 584)	(34 162)	(661)	(1 875)	(183)	(1 520)	(168)
(12 531)	(12 707)	(446)	(14 635)	296	(572)	(1 583)	(2 704)
(101)	(63)	410	(4)	32	(43)	(62)	(579)
(25 227)	18 185	(11 867)	(18 475)	(922)	(1 021)	(20 930)	(1 493)
2 628	(2 385)	(811)	(599)	480	156	91	1 346
5	(16)	24	233	(16)	27	(46)	(6)
(38 243)	(15 292)	(37 779)	(22 654)	(1 375)	(887)	(19 129)	(2 696)
(2 073)	(3 001)	(1 565)	(2 712)	(361)	(450)	(1 005)	(302)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	(4)	0
0	0	0	(8)	0	0	(8)	(2)
(2 073)	(3 001)	(1 565)	(2 720)	(361)	(450)	(1 017)	(304)
0	0	2	2	7	7	0	0
(2 073)	(3 001)	(1 563)	(2 718)	(354)	(443)	(1 017)	(304)
(40 316)	(18 293)	(39 342)	(25 372)	(1 729)	(1 330)	(20 146)	(3 000)
(18)	(6)	(9)	(68)	(5)	(8)	0	(5)
0	0	0	0	0	0	0	0
0	0	(20)	0	0	0	(1 282)	(157)
0	0	(1)	0	0	0	40	14
(18)	(6)	(30)	(68)	(5)	(8)	(1 242)	(148)
(40 334)	(18 299)	(39 372)	(25 440)	(1 734)	(1 338)	(21 388)	(3 148)
(3)	(22)	(78)	(160)	(3)	(22)	(9)	(3)
0	0	(2)	(6)	0	(1)	0	0
(40 337)	(18 321)	(39 452)	(25 606)	(1 737)	(1 361)	(21 397)	(3 151)
$ (40 337)	$ (18 321)	$ (39 452)	$ (25 606)	$ (1 737)	$ (1 361)	$ (21 397)	$ (3 151)

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Euro Bond Fund		Fonds Euro Credit Fund	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Produits				
Produits des intérêts et dividendes	€ 33 483	€ 26 715	€ 12 380	€ 14 395
Autres produits	0	0	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(99 204)	19 962	(37 541)	5 800
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	(79 983)	(42 057)	(74 566)	(19 646)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	423	9 559	2 974	(478)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(209 845)	(29 859)	(64 593)	(5 119)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	(36 654)	(47 819)	(2 141)	(4 036)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	2 140	(15 569)	711	1 601
Total des revenus/(pertes) sur investissements	(389 640)	(79 068)	(162 776)	(7 483)
Charges d'exploitation				
Frais de gestion	(11 086)	(15 500)	(3 957)	(4 932)
Frais de services	(66)	(98)	0	0
Frais de commercialisation	(9)	(16)	0	0
Autres charges	(3)	(3)	(1)	(1)
Total des charges	(11 164)	(15 617)	(3 958)	(4 933)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	625	854	179	123
Charges d'exploitation nettes	(10 539)	(14 763)	(3 779)	(4 810)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	(400 179)	(93 831)	(166 555)	(12 293)
Frais financiers				
Frais des intérêts	(204)	(280)	(179)	(48)
Frais de facilité de crédit	0	0	0	0
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	(969)	(1 018)	(1 172)	(1 588)
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	7	(180)	(99)	20
Total des frais financiers	(1 166)	(1 478)	(1 450)	(1 616)
Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt	(401 345)	(95 309)	(168 005)	(13 909)
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	(2)	216	4	(2)
Impôt sur les plus-values	0	0	0	0
Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt	(401 347)	(95 093)	(168 001)	(13 911)
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	€ (401 347)	€ (95 093)	€ (168 001)	€ (13 911)

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

Fonds Euro Income Bond Fund		Fonds Euro Long Average Duration Fund		Fonds Euro Short-Term Fund		Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	
Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
€ 40 277	€ 58 295	€ 1 889	€ 1 528	€ 5 127	€ 2 644	€ 6 062	€ 5 677
0	0	0	0	0	0	0	0
(93 499)	28 700	(7 406)	496	(11 983)	1 076	(4 104)	4 538
(26 595)	(22 526)	(10 447)	(776)	8 148	(8 680)	(2 508)	(1 742)
9 992	8 008	(10)	805	1 505	267	192	(116)
(166 879)	(23 298)	(32 163)	(9 864)	(12 596)	7 618	(16 840)	(2 394)
(14 850)	(15 249)	(10 591)	(5 638)	3 715	(2 780)	1 089	(175)
2 773	(16 940)	150	(799)	(257)	245	38	3
(248 781)	16 990	(58 578)	(14 248)	(6 341)	390	(16 071)	5 791
(18 349)	(29 149)	(597)	(774)	(1 714)	(2 538)	(54)	(44)
(73)	(91)	0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(156)	(219)	0	0	(1)	(1)	0	(4)
(18 578)	(29 459)	(597)	(774)	(1 715)	(2 539)	(54)	(48)
313	154	17	8	0	0	28	35
(18 265)	(29 305)	(580)	(766)	(1 715)	(2 539)	(26)	(13)
(267 046)	(12 315)	(59 158)	(15 014)	(8 056)	(2 149)	(16 097)	5 778
(102)	(121)	(14)	(13)	(84)	(227)	(33)	(44)
0	0	0	0	0	0	0	0
(14 923)	(17 281)	0	0	0	0	0	0
(1 288)	(1 291)	0	0	0	0	0	0
(16 313)	(18 693)	(14)	(13)	(84)	(227)	(33)	(44)
(283 359)	(31 008)	(59 172)	(15 027)	(8 140)	(2 376)	(16 130)	5 734
4	3	0	0	(6)	(1)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(283 355)	(31 005)	(59 172)	(15 027)	(8 146)	(2 377)	(16 130)	5 734
€ (283 355)	€ (31 005)	€ (59 172)	€ (15 027)	€ (8 146)	€ (2 377)	€ (16 130)	€ 5 734

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)	Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Fonds Global Advantage Fund	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Produits				
Produits des intérêts et dividendes	€ 5 046	€ 3 844	$ 19 358	$ 14 187
Autres produits	0	0	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(22 144)	567	(15 302)	6 980
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	20 693	(5 157)	(16 446)	(5 241)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	383	258	(143)	(55)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(16 574)	(1 990)	(65 430)	(34 287)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	2 641	(1 724)	2 911	(6 245)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	123	(1 434)	(46)	2 286
Total des revenus/(pertes) sur investissements	(9 832)	(5 636)	(75 098)	(22 375)
Charges d'exploitation				
Frais de gestion	(1 114)	(1 503)	(3 204)	(3 733)
Frais de services	0	0	0	0
Frais de commercialisation	0	0	0	0
Autres charges	0	0	(7)	(4)
Total des charges	(1 114)	(1 503)	(3 211)	(3 737)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	90	129	0	0
Charges d'exploitation nettes	(1 024)	(1 374)	(3 211)	(3 737)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	(10 856)	(7 010)	(78 309)	(26 112)
Frais financiers				
Frais des intérêts	(52)	(48)	(311)	(41)
Frais de facilité de crédit	0	0	0	0
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	0	0	(3 851)	(3 124)
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	0	0	19	0
Total des frais financiers	(52)	(48)	(4 143)	(3 165)
Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt	(10 908)	(7 058)	(82 452)	(29 277)
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	(1)	0	(28)	(17)
Impôt sur les plus-values	0	0	4	40
Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt	(10 909)	(7 058)	(82 476)	(29 254)
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	€ (10 909)	€ (7 058)	$ (82 476)	$ (29 254)

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

Fonds Global Bond Fund		Fonds Global Bond ESG Fund		Fonds Global Bond Ex-US Fund		Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	
Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
$ 280 279	$ 303 297	$ 45 557	$ 26 313	$ 18 377	$ 21 309	$ 15 505	$ 11 584
0	241	0	0	0	0	0	0
(472 968)	113 592	(191 964)	(4 030)	(26 490)	18 541	(53 006)	2 624
64 670	(143 992)	(1 708)	(39 838)	36 891	8 090	(108 236)	26 741
(37 039)	5 853	(6 537)	5 084	(2 783)	(1 997)	(849)	(2 110)
(1 518 236)	(920 990)	(179 201)	(95 675)	(98 263)	(69 872)	(30 206)	5 931
(349 556)	(118 386)	(74 875)	(5 207)	(19 836)	(1 298)	(34 286)	8 726
3 275	43 211	1 827	1 725	820	5 168	567	425
(2 029 575)	(717 174)	(406 901)	(111 628)	(91 284)	(20 059)	(210 511)	53 921
(73 778)	(96 239)	(11 828)	(9 410)	(4 332)	(5 259)	(10 327)	(10 596)
(1 350)	(1 868)	(38)	(51)	(29)	(65)	(31)	(34)
(118)	(90)	(3)	(11)	(57)	(58)	0	0
(149)	(219)	(3)	(2)	(4)	(1)	(2)	(1)
(75 395)	(98 416)	(11 872)	(9 474)	(4 422)	(5 383)	(10 360)	(10 631)
3 016	3 305	0	0	2	2	352	232
(72 379)	(95 111)	(11 872)	(9 474)	(4 420)	(5 381)	(10 008)	(10 399)
(2 101 954)	(812 285)	(418 773)	(121 102)	(95 704)	(25 440)	(220 519)	43 522
(1 977)	(1 103)	(463)	(16)	(268)	(61)	(235)	(24)
0	0	0	0	0	0	0	0
(28 813)	(31 940)	(7 667)	(5 279)	(1 708)	(1 880)	(2 897)	(3 010)
2 479	(554)	624	317	(133)	85	(516)	(231)
(28 311)	(33 597)	(7 506)	(4 978)	(2 109)	(1 856)	(3 648)	(3 265)
(2 130 265)	(845 882)	(426 279)	(126 080)	(97 813)	(27 296)	(224 167)	40 257
(366)	846	(45)	9	(10)	12	(721)	(96)
(9)	0	0	0	0	0	0	1
(2 130 640)	(845 036)	(426 324)	(126 071)	(97 823)	(27 284)	(224 888)	40 162
$ (2 130 640)	$ (845 036)	$ (426 324)	$ (126 071)	$ (97 823)	$ (27 284)	$ (224 888)	$ 40 162

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Global High Yield Bond Fund		Fonds Global Investment Grade Credit Fund	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Produits				
Produits des intérêts et dividendes	$ 188 614	$ 235 977	$ 390 373	$ 610 025
Autres produits	0	0	0	1 291
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(169 761)	79 208	(661 979)	467 996
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	(171 171)	(22 901)	(643 008)	(60 532)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	(11 131)	2 640	(47 103)	(46 775)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(601 507)	(217 798)	(1 965 880)	(1 518 257)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	(8 034)	(46 486)	(65 555)	(342 238)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	432	(309)	3 046	6 325
Total des revenus/(pertes) sur investissements	(772 558)	30 331	(2 990 106)	(882 165)
Charges d'exploitation				
Frais de gestion	(27 465)	(38 713)	(75 989)	(133 352)
Frais de services	(59)	(56)	(2 500)	(5 403)
Frais de commercialisation	(335)	(434)	(1 462)	(2 868)
Autres charges	(62)	(80)	(154)	(276)
Total des charges	(27 921)	(39 283)	(80 105)	(141 899)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	0	0	900	919
Charges d'exploitation nettes	(27 921)	(39 283)	(79 205)	(140 980)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	(800 479)	(8 952)	(3 069 311)	(1 023 145)
Frais financiers				
Frais des intérêts	(436)	(44)	(2 270)	(683)
Frais de facilité de crédit	(704)	(891)	0	0
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	(60 236)	(71 243)	(98 678)	(178 622)
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	(866)	620	(5 052)	(12 191)
Total des frais financiers	(62 242)	(71 558)	(106 000)	(191 496)
Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt	(862 721)	(80 510)	(3 175 311)	(1 214 641)
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	0	0	(425)	(277)
Impôt sur les plus-values	0	0	(18)	0
Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt	(862 721)	(80 510)	(3 175 754)	(1 214 918)
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	$ (862 721)	$ (80 510)	$ (3 175 754)	$ (1 214 918)

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

Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund		Fonds Global Low Duration Real Return Fund		Fonds Global Real Return Fund		Fonds Income Fund	
Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
$ 38 525	$ 13 337	$ 88 002	$ 44 076	$ 281 845	$ 120 963	$ 2 324 046	$ 2 333 029
0	0	0	0	0	0	0	1 183
(94 471)	456	(45 666)	15 275	(335 981)	72 666	(2 773 433)	535 116
(58 018)	(30 377)	14 927	(34 370)	206 342	(42 970)	1 069 480	331 534
(6 533)	2 946	(5 085)	3 055	(30 133)	4 703	(158 142)	(180 834)
(242 999)	(33 373)	(130 314)	(44 559)	(810 716)	(140 144)	(7 858 396)	(2 128 398)
7 204	6 412	14 994	3 426	862	22 146	491 740	(852 155)
327	(49)	(113)	(73)	(1 087)	(30)	(36 840)	47 526
(355 965)	(40 648)	(63 255)	(13 170)	(688 868)	37 334	(6 941 545)	87 001
(6 912)	(3 597)	(7 358)	(6 093)	(19 357)	(20 556)	(558 064)	(669 409)
(1)	0	(24)	(16)	(434)	(475)	(14 853)	(19 236)
(1 331)	(538)	0	0	(283)	(305)	(29 379)	(32 981)
(1)	0	(1)	(1)	(4)	(3)	(3 771)	(4 536)
(8 245)	(4 135)	(7 383)	(6 110)	(20 078)	(21 339)	(606 067)	(726 162)
0	0	0	0	0	0	1 010	1 032
(8 245)	(4 135)	(7 383)	(6 110)	(20 078)	(21 339)	(605 057)	(725 130)
(364 210)	(44 783)	(70 638)	(19 280)	(708 946)	15 995	(7 546 602)	(638 129)
(1 223)	(7)	(3 723)	(174)	(12 708)	(651)	(5 028)	(6 576)
0	0	0	0	0	0	0	0
(11 513)	(3 788)	(7 400)	(4 436)	(35 436)	(19 918)	(1 522 465)	(1 385 869)
707	765	12	202	(45)	(557)	(7 362)	11 585
(12 029)	(3 030)	(11 111)	(4 408)	(48 189)	(21 126)	(1 534 855)	(1 380 860)
(376 239)	(47 813)	(81 749)	(23 688)	(757 135)	(5 131)	(9 081 457)	(2 018 989)
(38)	(35)	0	0	7	9	(5 121)	2 865
0	0	0	0	(2)	0	(1 130)	0
(376 277)	(47 848)	(81 749)	(23 688)	(757 130)	(5 122)	(9 087 708)	(2 016 124)
$ (376 277)	$ (47 848)	$ (81 749)	$ (23 688)	$ (757 130)	$ (5 122)	$ (9 087 708)	$ (2 016 124)

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Income Fund II		Fonds Inflation Multi-Asset Fund[1]	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Période du 29 janv. 2021 au 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Produits				
Produits des intérêts et dividendes	$ 1 453	$ 604	$ 18 013	$ 3 691
Autres produits	0	0	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(1 292)	49	(11 601)	2 554
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	591	244	(14 589)	3 856
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	29	(23)	(1 046)	17
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(3 257)	(416)	(43 168)	(16)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	307	51	3 742	(1 199)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	(18)	(1)	46	(25)
Total des revenus/(pertes) sur investissements	(2 187)	508	(48 603)	8 878
Charges d'exploitation				
Frais de gestion	(362)	(139)	(4 863)	(1 293)
Frais de services	0	0	0	0
Frais de commercialisation	0	0	(41)	0
Autres charges	(2)	(1)	0	0
Total des charges	(364)	(140)	(4 904)	(1 293)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	0	0	0	0
Charges d'exploitation nettes	(364)	(140)	(4 904)	(1 293)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	(2 551)	368	(53 507)	7 585
Frais financiers				
Frais des intérêts	(2)	0	(42)	(6)
Frais de facilité de crédit	0	0	0	0
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	(828)	(26)	(732)	(59)
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	(88)	1	50	10
Total des frais financiers	(918)	(25)	(724)	(55)
Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt	(3 469)	343	(54 231)	7 530
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	(6)	(1)	(369)	(216)
Impôt sur les plus-values	0	0	0	0
Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt	(3 475)	342	(54 600)	7 314
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	$ (3 475)	$ 342	$ (54 600)	$ 7 314

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

(1) Le 13 avril 2022, le Fonds Inflation Strategy Fund a pris le nom de Fonds Inflation Multi-Asset Fund.
(2) Le 1er juillet 2022, le Fonds Global LIBOR Plus Bond Fund a pris le nom de Fonds Low Duration Opportunities Fund.

Fonds Low Average Duration Fund		Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Fonds Low Duration Income Fund		Fonds Low Duration Opportunities Fund[2]	
Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
$ 25 484	$ 10 934	$ 14 422	$ 12 323	$ 39 539	$ 29 025	$ 55 391	$ 46 121
0	0	0	0	0	0	0	0
(42 813)	(667)	(20 974)	5 594	(56 562)	3 984	(193 300)	(3 632)
10 878	(648)	(52 392)	(34 845)	(38 394)	(42 131)	(377 025)	3 043
(1 316)	238	(1 354)	1 207	(394)	999	(6 253)	5 878
(57 779)	(19 422)	(35 028)	(32 530)	(91 374)	(33 323)	(143 747)	(85 789)
(1 564)	(1 183)	(1 725)	(4 922)	4 463	5 278	(76 554)	3 555
253	98	115	(8)	(601)	440	132	(42)
(66 857)	(10 650)	(96 936)	(53 181)	(143 323)	(35 728)	(741 356)	(30 866)
(7 440)	(6 488)	(3 531)	(3 868)	(7 436)	(6 354)	(13 186)	(15 019)
(84)	(125)	0	0	(1)	(1)	(20)	(47)
(59)	(66)	0	0	0	0	0	0
(3)	(1)	(1)	(1)	(2)	(2)	(7)	(4)
(7 586)	(6 680)	(3 532)	(3 869)	(7 439)	(6 357)	(13 213)	(15 070)
169	172	0	0	0	0	214	218
(7 417)	(6 508)	(3 532)	(3 869)	(7 439)	(6 357)	(12 999)	(14 852)
(74 274)	(17 158)	(100 468)	(57 050)	(150 762)	(42 085)	(754 355)	(45 718)
(1 538)	(6)	(323)	(10)	(200)	(9)	(379)	(17)
0	0	0	0	0	0	0	0
(985)	(387)	(399)	(172)	(4 686)	(4 989)	(7 886)	(7 775)
51	(9)	3	20	(564)	64	104	378
(2 472)	(402)	(719)	(162)	(5 450)	(4 934)	(8 161)	(7 414)
(76 746)	(17 560)	(101 187)	(57 212)	(156 212)	(47 019)	(762 516)	(53 132)
(33)	(2)	0	0	(5)	11	(87)	(41)
0	0	0	0	0	0	(7)	0
(76 779)	(17 562)	(101 187)	(57 212)	(156 217)	(47 008)	(762 610)	(53 173)
$ (76 779)	$ (17 562)	$ (101 187)	$ (57 212)	$ (156 217)	$ (47 008)	$ (762 610)	$ (53 173)

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund	Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
	Période du 27 juil. 2022 au 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Produits			
Produits des intérêts et dividendes	$ 62	$ 4 517	$ 1 742
Autres produits	0	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	2	12 875	2 539
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	(37)	9 251	13 480
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	9	(73)	(103)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(22)	(1 853)	8 412
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	(45)	815	3 523
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	1	3	(4)
Total des revenus/(pertes) sur investissements	(30)	25 535	29 589
Charges d'exploitation			
Frais de gestion	(11)	(1 351)	(891)
Frais de services	0	0	(5)
Frais de commercialisation	0	0	0
Autres charges	0	0	0
Total des charges	(11)	(1 351)	(896)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	0	0	0
Charges d'exploitation nettes	(11)	(1 351)	(896)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	(41)	24 184	28 693
Frais financiers			
Frais des intérêts	0	(21)	(1)
Frais de facilité de crédit	0	0	0
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	0	(1 973)	(2 326)
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	0	(158)	(52)
Total des frais financiers	0	(2 152)	(2 379)
Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt	(41)	22 032	26 314
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	0	(1 066)	(524)
Impôt sur les plus-values	0	0	0
Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt	(41)	20 966	25 790
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	$ (41)	$ 20 966	$ 25 790

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

Fonds Mortgage Opportunities Fund		Fonds StocksPLUS™ Fund		Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Fonds Strategic Income Fund	
Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
$ 64 142	$ 61 815	$ 33 258	$ 21 704	$ 200	$ 89	$ 24 332	$ 32 261
0	0	0	0	0	0	0	329
(104 200)	(9 000)	(81 088)	9 276	(38)	57	(10 791)	77 423
(29 390)	(12 983)	(489 873)	865 225	(2 250)	2 395	(40 272)	(37 734)
(5 448)	1 494	(4 542)	6 220	18	(6)	(504)	(97)
(167 826)	(47 271)	(73 113)	(43 299)	(374)	(163)	(66 591)	(52 104)
(16 819)	21 700	(87 127)	(90 840)	(231)	125	16 280	(8 337)
(1 441)	(107)	(18)	115	0	1	(284)	868
(260 982)	15 648	(702 503)	768 401	(2 675)	2 498	(77 830)	12 609
(9 762)	(12 411)	(12 870)	(19 756)	(73)	(71)	(7 425)	(9 903)
(116)	(225)	(60)	(70)	0	0	0	0
(1)	(3)	0	0	0	0	0	0
(17)	(4)	(6)	(13)	0	0	(105)	(119)
(9 896)	(12 643)	(12 936)	(19 839)	(73)	(71)	(7 530)	(10 022)
0	0	0	0	1	1	0	0
(9 896)	(12 643)	(12 936)	(19 839)	(72)	(70)	(7 530)	(10 022)
(270 878)	3 005	(715 439)	748 562	(2 747)	2 428	(85 360)	2 587
(7 142)	(154)	(199)	(108)	0	(1)	(225)	(111)
0	0	0	0	0	0	0	0
(9 330)	(12 279)	(218)	0	0	0	(5 529)	(5 762)
(159)	45	(322)	35	0	0	171	(41)
(16 631)	(12 388)	(739)	(73)	0	(1)	(5 583)	(5 914)
(287 509)	(9 383)	(716 178)	748 489	(2 747)	2 427	(90 943)	(3 327)
0	0	10	(14)	0	0	(1 177)	(1 700)
0	0	0	0	0	0	(9)	0
(287 509)	(9 383)	(716 168)	748 475	(2 747)	2 427	(92 129)	(5 027)
$ (287 509)	$ (9 383)	$ (716 168)	$ 748 475	$ (2 747)	$ 2 427	$ (92 129)	$ (5 027)

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Total Return Bond Fund		Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Produits				
Produits des intérêts et dividendes	$ 114 210	$ 117 233	$ 3 645	$ 202
Autres produits	0	0	0	0
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(308 687)	21 935	(4 374)	(25)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	18 095	(66 800)	1 422	(207)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	(10 559)	8 396	(599)	(302)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(628 624)	(271 256)	4 540	(79)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	2 689	(18 674)	(7 427)	1 783
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	(795)	(37)	(70)	5
Total des revenus/(pertes) sur investissements	(813 671)	(209 203)	(2 863)	1 377
Charges d'exploitation				
Frais de gestion	(32 300)	(44 468)	(2 340)	(1 202)
Frais de services	(1 509)	(2 011)	0	0
Frais de commercialisation	(722)	(892)	0	0
Autres charges	(44)	(69)	0	0
Total des charges	(34 575)	(47 440)	(2 340)	(1 202)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	512	1 159	25	7
Charges d'exploitation nettes	(34 063)	(46 281)	(2 315)	(1 195)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	(847 734)	(255 484)	(5 178)	182
Frais financiers				
Frais des intérêts	(857)	(74)	(89)	(20)
Frais de facilité de crédit	0	0	0	0
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	(14 771)	(14 602)	(319)	0
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	138	(47)	159	0
Total des frais financiers	(15 490)	(14 723)	(249)	(20)
Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt	(863 224)	(270 207)	(5 427)	162
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	(288)	(84)	0	0
Impôt sur les plus-values	0	0	0	0
Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt	(863 512)	(270 291)	(5 427)	162
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	$ (863 512)	$ (270 291)	$ (5 427)	$ 162

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

Fonds UK Corporate Bond Fund		Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund		Fonds US High Yield Bond Fund		Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	
Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
£ 11 760	£ 13 061	£ 11 151	£ 10 633	$ 156 507	$ 201 773	$ 18 748	$ 33 144
0	0	0	0	0	0	0	0
(30 472)	12 821	(27 835)	8 091	(135 436)	33 353	(82 238)	7 951
(18 338)	3 235	(26 173)	665	(77 001)	(23 016)	(42 587)	(19 621)
(25)	(1 263)	131	(808)	(1 909)	586	(237)	42
(66 723)	(47 407)	(80 017)	(30 310)	(441 841)	(56 784)	(56 269)	(59 491)
3 502	(2 700)	1 687	(487)	3 016	(17 594)	(8 065)	(10 285)
96	61	79	148	51	(33)	93	132
(100 200)	(22 192)	(120 977)	(12 068)	(496 613)	138 285	(170 555)	(48 128)
(1 843)	(2 498)	(1 596)	(1 827)	(18 237)	(26 847)	(2 797)	(5 417)
0	0	0	0	(1 231)	(1 558)	0	0
0	0	0	0	0	0	0	0
(1)	(1)	(2)	(1)	(10)	(5)	(1)	(1)
(1 844)	(2 499)	(1 598)	(1 828)	(19 478)	(28 410)	(2 798)	(5 418)
12	126	0	5	0	0	0	0
(1 832)	(2 373)	(1 598)	(1 823)	(19 478)	(28 410)	(2 798)	(5 418)
(102 032)	(24 565)	(122 575)	(13 891)	(516 091)	109 875	(173 353)	(53 546)
(164)	(32)	(76)	(31)	(38)	(94)	(42)	(42)
0	0	0	0	(553)	(616)	0	0
(7 385)	(7 318)	(1 401)	(1 320)	(28 068)	(32 603)	(6 002)	(17 509)
147	(330)	0	0	(1 127)	1 195	(1 021)	(369)
(7 402)	(7 680)	(1 477)	(1 351)	(29 786)	(32 118)	(7 065)	(17 920)
(109 434)	(32 245)	(124 052)	(15 242)	(545 877)	77 757	(180 418)	(71 466)
6	14	0	2	(22)	0	(60)	(57)
0	0	0	0	0	0	0	0
(109 428)	(32 231)	(124 052)	(15 240)	(545 899)	77 757	(180 478)	(71 523)
£ (109 428)	£ (32 231)	£ (124 052)	£ (15 240)	$ (545 899)	$ 77 757	$ (180 478)	$ (71 523)

Compte de résultat (suite)

(Montants en milliers)	Fonds US Short-Term Fund		Total Société*	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Produits				
Produits des intérêts et dividendes	$ 55 566	$ 31 255	$ 6 178 757	$ 6 303 134
Autres produits	0	72	0	3 116
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(71 854)	13 161	(8 968 907)	2 413 798
Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés	58 715	(4 690)	(2 110 326)	(14 600)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change	(2 268)	2 843	(570 612)	(290 548)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit	(75 579)	(51 366)	(21 700 661)	(8 960 122)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés	16 121	(6 311)	(473 258)	(1 793 785)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente de change	(37)	852	(34 364)	137 404
Total des revenus/(pertes) sur investissements	(19 336)	(14 184)	(27 679 371)	(2 201 603)
Charges d'exploitation				
Frais de gestion	(10 218)	(11 997)	(1 395 118)	(1 794 845)
Frais de services	(51)	(76)	(25 946)	(36 004)
Frais de commercialisation	0	0	(36 489)	(41 978)
Autres charges	(3)	(3)	(6 292)	(7 868)
Total des charges	(10 272)	(12 076)	(1 463 845)	(1 880 695)
Remboursement effectué par les Conseillers en investissement	874	1 085	12 309	17 786
Charges d'exploitation nettes	(9 398)	(10 991)	(1 451 536)	(1 862 909)
Revenu/(perte) net(te) sur investissements	(28 734)	(25 175)	(29 130 907)	(4 064 512)
Frais financiers				
Frais des intérêts	(1 332)	(37)	(69 903)	(26 834)
Frais de facilité de crédit	0	0	(1 257)	(1 507)
Distributions aux porteurs d'actions de participation rachetables	(15 307)	(10 146)	(2 279 520)	(2 292 758)
Crédits et (charges) net(te)s de péréquation	896	(135)	(23 010)	5 675
Total des frais financiers	(15 743)	(10 318)	(2 373 690)	(2 315 424)
Bénéfice/(perte) de l'exercice avant impôt	(44 477)	(35 493)	(31 504 597)	(6 379 936)
Retenues à la source sur les dividendes et autres revenus découlant de l'investissement	1	12	(21 859)	(9 779)
Impôt sur les plus-values	0	0	(1 417)	747
Bénéfice/(perte) de l'exercice après impôt	(44 476)	(35 481)	(31 527 873)	(6 388 968)
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	$ (44 476)	$ (35 481)	$ (31 527 873)	$ (6 388 968)

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

* Le Total Société pour l'exercice clos le 31 décembre 2022 et l'exercice clos le 31 décembre 2021 a été ajusté pour éliminer des investissements croisés et des soldes au nom de la Société. Veuillez vous reporter à la Note 14 des Notes relatives aux États financiers pour plus de détails sur les investissements croisés.

(Cette page est laissée vierge volontairement)

État de l'évolution des actifs nets

(Montants en milliers)	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund		Fonds PIMCO Capital Securities Fund	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Actifs nets au début de l'exercice	$ 3 411 923	$ 890 928	$ 361 011	$ 167 716	$ 9 110 409	$ 7 958 322
Produits des actions émises	2 053 140	3 621 247	98 659	259 978	1 684 526	4 540 326
Produits des réinvestissements des distributions	10 176	1 386	762	112	10 326	9 607
Paiements au titre du rachat d'actions	(1 858 479)	(765 332)	(89 514)	(41 694)	(3 728 874)	(3 434 342)
Ajustement du taux de change notionnel	0	0	0	0	0	0
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	(635 368)	(336 306)	(56 931)	(25 101)	(1 354 796)	36 496
Actifs nets à la fin de l'exercice	$ 2 981 392	$ 3 411 923	$ 313 987	$ 361 011	$ 5 721 591	$ 9 110 409

	Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund		Fonds Diversified Income ESG Fund	Fonds Dynamic Bond Fund	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Période du 27 juil. 2022 au 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Actifs nets au début de l'exercice	$ 1 305 365	$ 1 486 931	$ 0	$ 3 277 997	$ 3 204 860
Produits des actions émises	68 633	448 782	9 954	1 763 140	1 528 096
Produits des réinvestissements des distributions	34	23	0	1 413	1 696
Paiements au titre du rachat d'actions	(612 551)	(596 657)	0	(1 068 332)	(1 343 284)
Ajustement du taux de change notionnel	0	0	0	0	0
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	(196 797)	(33 714)	(100)	(490 617)	(113 371)
Actifs nets à la fin de l'exercice	$ 564 684	$ 1 305 365	$ 9 854	$ 3 483 601	$ 3 277 997

	Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund		Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund		Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Actifs nets au début de l'exercice	$ 2 635 769	$ 1 441 457	$ 212 894	$ 261 236	$ 290 475	$ 220 309
Produits des actions émises	1 511 574	2 226 780	26 594	42 380	167 062	157 673
Produits des réinvestissements des distributions	2 170	47	0	0	20	0
Paiements au titre du rachat d'actions	(948 773)	(825 918)	(30 165)	(72 401)	(212 974)	(61 901)
Ajustement du taux de change notionnel	0	0	0	0	0	0
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	(708 265)	(206 597)	(40 337)	(18 321)	(39 452)	(25 606)
Actifs nets à la fin de l'exercice	$ 2 492 475	$ 2 635 769	$ 168 986	$ 212 894	$ 205 131	$ 290 475

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

	Fonds PIMCO Climate Bond Fund		Fonds Commodity Real Return Fund		Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		Fonds Diversified Income Fund	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
	$ 328 081	$ 101 869	$ 1 444 182	$ 325 109	$ 139 704	$ 144 512	$ 16 447 733	$ 18 641 861
	140 136	278 727	1 475 400	1 354 368	9 058	22 812	1 896 447	6 270 901
	136	6	0	0	0	0	16 545	18 607
	(101 860)	(32 957)	(1 623 269)	(401 731)	(38 655)	(23 013)	(6 169 181)	(7 562 529)
	0	0	0	0	0	0	0	0
	(73 838)	(19 564)	73 564	166 436	(12 954)	(4 607)	(3 439 748)	(921 107)
	$ 292 655	$ 328 081	$ 1 369 877	$ 1 444 182	$ 97 153	$ 139 704	$ 8 751 796	$ 16 447 733

	Fonds Dynamic Multi-Asset Fund		Fonds Emerging Local Bond Fund		Fonds Emerging Local Bond ESG Fund	Fonds Emerging Markets Bond Fund	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Période du 27 juil. 2022 au 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
	€ 7 635 950	€ 5 128 926	$ 2 151 129	$ 2 849 284	$ 0	$ 4 714 744	$ 5 263 015
	862 412	4 955 709	803 400	1 175 064	6 206	1 975 229	2 839 067
	92	91	1 998	1 937	1	3 115	3 750
	(2 381 432)	(2 465 349)	(864 659)	(1 635 674)	0	(2 402 706)	(3 028 013)
	0	0	0	0	0	0	0
	(1 001 852)	16 573	(172 200)	(239 482)	402	(984 403)	(363 075)
	€ 5 115 170	€ 7 635 950	$ 1 919 668	$ 2 151 129	$ 6 609	$ 3 305 979	$ 4 714 744

	Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		Fonds PIMCO ESG Income Fund		Fonds Euro Bond Fund		Fonds Euro Credit Fund	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Période du 29 avr. 2021 au 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
	$ 29 760	$ 32 571	$ 125 087	$ 0	€ 2 574 129	€ 3 243 455	€ 1 017 163	€ 1 150 058
	8 145	26 458	172 394	132 126	335 598	582 897	434 310	464 795
	0	0	465	36	0	0	320	464
	(15 231)	(27 908)	(38 588)	(3 924)	(595 105)	(1 157 130)	(673 784)	(584 243)
	0	0	0	0	0	0	0	0
	(1 737)	(1 361)	(21 397)	(3 151)	(401 347)	(95 093)	(168 001)	(13 911)
	$ 20 937	$ 29 760	$ 237 961	$ 125 087	€ 1 913 275	€ 2 574 129	€ 610 008	€ 1 017 163

État de l'évolution des actifs nets (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Euro Income Bond Fund		Fonds Euro Long Average Duration Fund		Fonds Euro Short-Term Fund	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Actifs nets au début de l'exercice	€ 2 482 304	€ 3 182 867	€ 160 601	€ 182 461	€ 629 859	€ 807 538
Produits des actions émises	446 648	750 472	40 010	56 603	249 387	218 558
Produits des réinvestissements des distributions	1 221	1 337	0	0	0	0
Paiements au titre du rachat d'actions	(1 293 838)	(1 421 367)	(31 391)	(63 436)	(518 005)	(393 860)
Ajustement du taux de change notionnel	0	0	0	0	0	0
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	(283 355)	(31 005)	(59 172)	(15 027)	(8 146)	(2 377)
Actifs nets à la fin de l'exercice	€ 1 352 980	€ 2 482 304	€ 110 048	€ 160 601	€ 353 095	€ 629 859

	Fonds Global Bond ESG Fund		Fonds Global Bond Ex-US Fund		Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Actifs nets au début de l'exercice	$ 2 302 966	$ 1 509 594	$ 911 707	$ 929 980	$ 1 035 021	$ 702 430
Produits des actions émises	1 882 825	1 385 787	307 762	336 178	175 286	453 398
Produits des réinvestissements des distributions	4 271	2 544	678	823	7	11
Paiements au titre du rachat d'actions	(657 548)	(468 888)	(406 302)	(327 990)	(235 350)	(160 980)
Ajustement du taux de change notionnel	0	0	0	0	0	0
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	(426 324)	(126 071)	(97 823)	(27 284)	(224 888)	40 162
Actifs nets à la fin de l'exercice	$ 3 106 190	$ 2 302 966	$ 716 022	$ 911 707	$ 750 076	$ 1 035 021

	Fonds Global Real Return Fund		Fonds Income Fund		Fonds Income Fund II	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Période du 29 janv. 2021 au 31 déc. 2021
Actifs nets au début de l'exercice	$ 3 703 379	$ 2 578 062	$ 73 579 726	$ 71 275 311	$ 27 770	$ 0
Produits des actions émises	881 779	2 198 876	18 117 060	32 285 151	35 679	27 404
Produits des réinvestissements des distributions	4 676	3 062	124 031	91 069	62	25
Paiements au titre du rachat d'actions	(1 260 842)	(1 071 499)	(24 752 782)	(28 055 681)	(3 413)	(1)
Ajustement du taux de change notionnel	0	0	0	0	0	0
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	(757 130)	(5 122)	(9 087 708)	(2 016 124)	(3 475)	342
Actifs nets à la fin de l'exercice	$ 2 571 862	$ 3 703 379	$ 57 980 327	$ 73 579 726	$ 56 623	$ 27 770

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

(1) Le 13 avril 2022, le Fonds Inflation Strategy Fund a pris le nom de Fonds Inflation Multi-Asset Fund.

Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund		Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Fonds Global Advantage Fund		Fonds Global Bond Fund	
Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
€ 170 489	€ 162 061	€ 395 491	€ 350 749	$ 521 067	$ 524 284	$ 14 038 846	$ 16 302 309
37 975	8 086	69 639	205 761	25 733	76 128	3 949 985	4 180 638
0	0	0	0	0	0	3 168	2 549
(18 172)	(5 392)	(243 049)	(153 961)	(53 865)	(50 091)	(4 441 247)	(5 601 614)
0	0	0	0	0	0	0	0
(16 130)	5 734	(10 909)	(7 058)	(82 476)	(29 254)	(2 130 640)	(845 036)
€ 174 162	€ 170 489	€ 211 172	€ 395 491	$ 410 459	$ 521 067	$ 11 420 112	$ 14 038 846

Fonds Global High Yield Bond Fund		Fonds Global Investment Grade Credit Fund		Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund		Fonds Global Low Duration Real Return Fund	
Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
$ 5 169 160	$ 5 403 543	$ 17 154 925	$ 28 178 170	$ 1 189 563	$ 332 010	$ 1 199 076	$ 787 871
1 424 841	3 122 850	3 907 121	7 389 072	1 086 602	1 213 204	1 093 289	741 595
2 721	3 266	4 308	10 357	366	574	2	2
(2 631 133)	(3 279 989)	(7 352 259)	(17 207 756)	(530 364)	(308 377)	(846 243)	(306 704)
0	0	0	0	0	0	0	0
(862 721)	(80 510)	(3 175 754)	(1 214 918)	(376 277)	(47 848)	(81 749)	(23 688)
$ 3 102 868	$ 5 169 160	$ 10 538 341	$ 17 154 925	$ 1 369 890	$ 1 189 563	$ 1 364 375	$ 1 199 076

Fonds Inflation Multi-Asset Fund[1]		Fonds Low Average Duration Fund		Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Fonds Low Duration Income Fund	
Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
$ 164 345	$ 70 032	$ 1 179 138	$ 1 183 413	$ 806 869	$ 632 519	$ 1 367 475	$ 960 639
474 503	115 894	1 413 022	688 563	182 884	382 649	597 584	746 949
230	0	309	83	254	0	67	26
(181 400)	(28 895)	(1 442 932)	(675 359)	(234 071)	(151 087)	(724 529)	(293 131)
0	0	0	0	0	0	0	0
(54 600)	7 314	(76 779)	(17 562)	(101 187)	(57 212)	(156 217)	(47 008)
$ 403 078	$ 164 345	$ 1 072 758	$ 1 179 138	$ 654 749	$ 806 869	$ 1 084 380	$ 1 367 475

État de l'évolution des actifs nets (suite)

(Montants en milliers)	Fonds Low Duration Opportunities Fund[2]		Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund	Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Période du 27 juil. 2022 au 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Actifs nets au début de l'exercice	$ 3 217 260	$ 2 644 601	$ 0	$ 100 538	$ 77 631
Produits des actions émises	880 588	1 559 905	4 969	78 857	44 785
Produits des réinvestissements des distributions	869	643	0	6	1
Paiements au titre du rachat d'actions	(1 990 326)	(934 716)	0	(80 230)	(47 669)
Ajustement du taux de change notionnel	0	0	0	0	0
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	(762 610)	(53 173)	(41)	20 966	25 790
Actifs nets à la fin de l'exercice	$ 1 345 781	$ 3 217 260	$ 4 928	$ 120 137	$ 100 538

	Fonds Total Return Bond Fund		Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		Fonds UK Corporate Bond Fund	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Actifs nets au début de l'exercice	$ 4 944 898	$ 6 424 053	$ 101 789	$ 47 221	£ 592 164	£ 764 359
Produits des actions émises	1 455 704	1 468 936	446 424	79 518	89 056	202 988
Produits des réinvestissements des distributions	8 134	7 905	2	0	1	15
Paiements au titre du rachat d'actions	(1 394 507)	(2 685 705)	(106 864)	(25 112)	(182 620)	(342 967)
Ajustement du taux de change notionnel	0	0	0	0	0	0
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	(863 512)	(270 291)	(5 427)	162	(109 428)	(32 231)
Actifs nets à la fin de l'exercice	$ 4 150 717	$ 4 944 898	$ 435 924	$ 101 789	£ 389 173	£ 592 164

	Total Société*	
	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Actifs nets au début de l'exercice	$ 209 342 798	$ 215 950 477
Produits des actions émises	59 195 422	99 474 968
Produits des réinvestissements des distributions	229 935	197 894
Paiements au titre du rachat d'actions	(84 448 259)	(98 628 652)
Ajustement du taux de change notionnel	(1 267 504)	(1 262 921)
Augmentation/(diminution) de l'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables découlant de l'exploitation	(31 527 873)	(6 388 968)
Actifs nets à la fin de l'exercice	$ 151 524 519	$ 209 342 798

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

(2) Le 1er juillet 2022, le Fonds Global LIBOR Plus Bond Fund a pris le nom de Fonds Low Duration Opportunities Fund.

* Le Total Société pour l'exercice clos le 31 décembre 2022 et l'exercice clos le 31 décembre 2021 a été ajusté pour éliminer des investissements croisés et des soldes au nom de la Société. Veuillez vous reporter à la Note 14 des Notes relatives aux États financiers pour plus de détails sur les investissements croisés.

Fonds Mortgage Opportunities Fund		Fonds StocksPLUS™ Fund		Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		Fonds Strategic Income Fund	
Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
$ 2 238 424	$ 1 977 007	$ 3 761 156	$ 3 538 833	$ 11 610	$ 8 417	$ 619 928	$ 974 664
944 728	1 194 468	951 977	2 271 566	1 511	1 145	179 697	190 976
4 620	4 404	215	0	0	0	15	11
(2 051 115)	(928 072)	(2 988 441)	(2 797 718)	(846)	(379)	(200 954)	(540 696)
0	0	0	0	0	0	0	0
(287 509)	(9 383)	(716 168)	748 475	(2 747)	2 427	(92 129)	(5 027)
$ 849 148	$ 2 238 424	$ 1 008 739	$ 3 761 156	$ 9 528	$ 11 610	$ 506 557	$ 619 928

Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund		Fonds US High Yield Bond Fund		Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund		Fonds US Short-Term Fund	
Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
£ 425 748	£ 364 631	$ 3 923 786	$ 4 054 927	$ 878 100	$ 1 180 148	$ 2 650 198	$ 3 654 185
108 291	124 748	744 251	2 106 890	223 870	349 575	1 278 210	1 086 979
2	743	5 395	6 919	3 292	13 646	13 355	9 488
(84 969)	(49 134)	(2 142 611)	(2 322 707)	(536 262)	(593 746)	(1 587 172)	(2 064 973)
0	0	0	0	0	0	0	0
(124 052)	(15 240)	(545 899)	77 757	(180 478)	(71 523)	(44 476)	(35 481)
£ 325 020	£ 425 748	$ 1 984 922	$ 3 923 786	$ 388 522	$ 878 100	$ 2 310 115	$ 2 650 198

Tableau des investissements Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES NÉGOCIABLES				
AUSTRALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Emeco Pty. Ltd.				
6,250 % éch. 10/07/2026	AUD	11 810	$ 7 342	0,25
Mineral Resources Ltd.				
8,000 % éch. 01/11/2027	$	16 040	16 423	0,55
8,125 % éch. 01/05/2027		9 496	9 578	0,32
Total Australie			33 343	1,12
BRÉSIL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
CSN Resources S.A.				
4,625 % éch. 10/06/2031		5 000	3 966	0,13
ÎLES CAÏMANS				
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES				
Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd.				
0,000 % éch. 22/01/2026 (b)		12 100	11 220	0,38
Meituan				
0,000 % éch. 27/04/2027 (b)		1 900	1 650	0,05
0,000 % éch. 27/04/2028 (b)		14 200	11 978	0,40
Vnet Group, Inc.				
0,000 % éch. 01/02/2026 (b)		10 100	8 282	0,28
Zhongsheng Group Holdings Ltd.				
0,000 % éch. 21/05/2025 (b)	HKD	69 000	10 060	0,34
			43 190	1,45
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AAC Technologies Holdings, Inc.				
3,000 % éch. 27/11/2024	$	14 730	13 562	0,45
Agile Group Holdings Ltd.				
5,500 % éch. 21/04/2025		14 195	7 622	0,26
5,500 % éch. 17/05/2026		7 500	3 439	0,12
7,875 % éch. 31/07/2024 (d)		16 487	4 089	0,14
8,375 % éch. 04/12/2023 (d)		11 300	2 857	0,10
China Evergrande Group				
10,000 % éch. 11/04/2023 ^		9 300	668	0,02
China Hongqiao Group Ltd.				
6,250 % éch. 08/06/2024		16 900	15 815	0,53
China Modern Dairy Holdings Ltd.				
2,125 % éch. 14/07/2026		23 100	19 637	0,66
China SCE Group Holdings Ltd.				
5,950 % éch. 29/09/2024		3 900	1 699	0,06
6,000 % éch. 04/02/2026		10 150	3 806	0,13
7,000 % éch. 02/05/2025		19 400	7 760	0,26
7,375 % éch. 09/04/2024		5 000	2 281	0,08
CIFI Holdings Group Co. Ltd.				
5,250 % éch. 13/05/2026 ^		13 452	3 556	0,12
5,950 % éch. 20/10/2025 ^		5 867	1 551	0,05
6,000 % éch. 16/07/2025 ^		8 000	2 102	0,07
6,450 % éch. 07/11/2024 ^		21 695	5 808	0,19
6,550 % éch. 28/03/2024 ^		3 098	831	0,03
Country Garden Holdings Co. Ltd.				
2,700 % éch. 12/07/2026		13 400	7 672	0,26
3,125 % éch. 22/10/2025		9 180	5 633	0,19
3,300 % éch. 12/01/2031		13 119	6 941	0,23
3,875 % éch. 22/10/2030		24 644	13 096	0,44
4,200 % éch. 06/02/2026		18 000	11 058	0,37
4,800 % éch. 06/08/2030		8 300	4 435	0,15
5,125 % éch. 17/01/2025		5 900	3 996	0,13
5,125 % éch. 14/01/2027		38 100	22 080	0,74
5,400 % éch. 27/05/2025		8 090	5 394	0,18
5,625 % éch. 15/12/2026		2 000	1 197	0,04
5,625 % éch. 14/01/2030		12 550	6 701	0,22
6,150 % éch. 17/09/2025		8 300	5 451	0,18
6,500 % éch. 08/04/2024		6 000	4 550	0,15
7,250 % éch. 08/04/2026		23 820	15 206	0,51
8,000 % éch. 27/01/2024		15 300	11 860	0,40
eHi Car Services Ltd.				
7,000 % éch. 21/09/2026		14 450	8 979	0,30
7,750 % éch. 14/11/2024		14 700	9 776	0,33
FWD Group Ltd.				
5,750 % éch. 09/07/2024		200	192	0,01
8,045 % éch. 15/06/2023 (d)		200	183	0,01
FWD Ltd.				
5,000 % éch. 24/09/2024		200	194	0,01
Geely Automobile Holdings Ltd.				
4,000 % éch. 09/12/2024 (d)	$	8 300	$ 7 553	0,25
Greentown China Holdings Ltd.				
4,700 % éch. 29/04/2025		6 700	6 047	0,20
Health & Happiness H&H International Holdings Ltd.				
5,625 % éch. 24/10/2024		26 835	23 856	0,80
Kaisa Group Holdings Ltd.				
8,500 % éch. 30/06/2022 ^		17 900	2 506	0,08
9,375 % éch. 30/06/2024 ^		15 750	2 213	0,07
9,750 % éch. 28/09/2023 ^		13 200	1 858	0,06
10,500 % éch. 15/01/2025 ^		20 200	2 843	0,10
10,875 % éch. 23/07/2023 ^		9 800	1 380	0,05
11,250 % éch. 09/04/2022 ^		6 700	861	0,03
11,700 % éch. 11/11/2025 ^		1 450	204	0,01
11,950 % éch. 22/10/2022 ^		800	111	0,00
11,950 % éch. 12/11/2023 ^		12 100	1 703	0,06
KWG Group Holdings Ltd.				
5,875 % éch. 10/11/2024		11 900	5 185	0,17
5,950 % éch. 10/08/2025		18 323	7 584	0,25
6,300 % éch. 13/02/2026		18 400	7 314	0,24
7,400 % éch. 13/01/2027		3 500	1 300	0,04
Melco Resorts Finance Ltd.				
4,875 % éch. 06/06/2025		41 260	37 961	1,27
5,250 % éch. 26/04/2026		8 324	7 338	0,25
5,625 % éch. 17/07/2027		5 450	4 683	0,16
5,750 % éch. 21/07/2028		46 777	39 186	1,31
MGM China Holdings Ltd.				
4,750 % éch. 01/02/2027		29 955	26 538	0,89
5,250 % éch. 18/06/2025		8 500	8 007	0,27
5,375 % éch. 15/05/2024		3 000	2 900	0,10
5,875 % éch. 15/05/2026		11 300	10 570	0,35
New Metro Global Ltd.				
4,500 % éch. 02/05/2026		10 900	7 410	0,25
6,800 % éch. 05/08/2023		6 800	6 290	0,21
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.				
5,950 % éch. 30/04/2025		17 745	5 250	0,18
6,250 % éch. 10/08/2024		12 530	3 887	0,13
6,950 % éch. 23/07/2023		1 988	690	0,02
Sands China Ltd.				
2,800 % éch. 08/03/2027		4 334	3 718	0,12
4,300 % éch. 08/01/2026		61 160	56 522	1,89
4,875 % éch. 18/06/2030		1 000	880	0,03
5,625 % éch. 08/08/2025		33 500	32 073	1,08
5,900 % éch. 08/08/2028		14 600	13 690	0,46
Seazen Group Ltd.				
4,450 % éch. 13/07/2025		14 100	9 938	0,33
6,000 % éch. 12/08/2024		14 100	11 082	0,37
Shui On Development Holding Ltd.				
5,500 % éch. 03/03/2025		1 500	1 268	0,04
5,500 % éch. 29/06/2026		12 500	10 105	0,34
6,150 % éch. 24/08/2024		2 250	1 974	0,07
Sunac China Holdings Ltd.				
5,950 % éch. 26/04/2024 ^		3 800	832	0,03
6,500 % éch. 09/07/2023 ^		13 500	2 996	0,10
6,500 % éch. 26/01/2026 ^		10 600	2 201	0,07
6,650 % éch. 03/08/2024 ^		19 400	4 215	0,14
6,800 % éch. 20/10/2024 ^		12 700	2 830	0,09
7,000 % éch. 09/07/2025 ^		9 200	2 011	0,07
7,500 % éch. 01/02/2024 ^		2 000	444	0,01
7,950 % éch. 11/10/2023 ^		10 000	2 194	0,07
8,350 % éch. 19/04/2023 ^		19 200	4 236	0,14
Times China Holdings Ltd.				
5,550 % éch. 04/06/2024		16 400	3 192	0,11
6,200 % éch. 22/03/2026		8 000	1 377	0,05
6,600 % éch. 02/03/2023		7 236	1 740	0,06
6,750 % éch. 16/07/2023		2 980	659	0,02
VLL International, Inc.				
5,750 % éch. 28/11/2024		24 185	22 827	0,77
Wynn Macau Ltd.				
4,875 % éch. 01/10/2024		10 471	9 903	0,33
5,125 % éch. 15/12/2029		2 851	2 311	0,08
5,500 % éch. 15/01/2026		29 744	27 332	0,92
5,500 % éch. 01/10/2027		19 713	17 262	0,58
5,625 % éch. 26/08/2028		23 930	20 491	0,69
Zhongsheng Group Holdings Ltd.				
3,000 % éch. 13/01/2026		2 850	2 551	0,09
			747 759	25,07
Total Îles Caïmans			790 949	26,52
CHINE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Dalian Wanda Commercial Management Group Co. Ltd.				
4,700 % éch. 03/06/2023	CNY	30 000	$ 4 160	0,14
4,890 % éch. 17/04/2023		10 000	1 416	0,05
Flourish Century				
6,600 % éch. 04/02/2049 ^(g)	$	10 900	1 209	0,04
Greenland Global Investment Ltd.				
5,875 % éch. 03/07/2026		8 550	2 907	0,10
7,250 % éch. 22/01/2027		21 949	7 355	0,25
New Metro Global Ltd.				
4,625 % éch. 15/10/2025		4 500	3 161	0,10
4,800 % éch. 15/12/2024		18 300	14 196	0,48
Yango Group Co. Ltd.				
6,900 % éch. 31/10/2022 ^	CNY	40 000	763	0,02
Yango Justice International Ltd.				
7,500 % éch. 15/04/2024 ^	$	17 800	650	0,02
7,500 % éch. 17/02/2025 ^		3 000	109	0,00
7,875 % éch. 04/09/2024 ^		5 800	212	0,01
8,250 % éch. 25/11/2023 ^		4 400	161	0,01
9,250 % éch. 15/04/2023 ^		10 900	398	0,01
ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd.				
3,125 % éch. 16/07/2025		18 980	16 513	0,55
3,500 % éch. 08/03/2026		4 590	3 878	0,13
Total Chine			57 088	1,91
FRANCE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BNP Paribas S.A.				
7,750 % éch. 16/08/2029 (d)(f)		4 500	4 455	0,15
9,250 % éch. 17/11/2027 (d)(f)		4 100	4 285	0,14
Société Générale S.A.				
9,375 % éch. 22/11/2027 (d)(f)		8 600	8 847	0,30
Total France			17 587	0,59
ALLEMAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Deutsche Bank AG				
4,500 % éch. 30/11/2026 (d)(f)	€	6 000	5 019	0,17
10,000 % éch. 01/12/2027 (d)(f)		5 600	6 195	0,21
Total Allemagne			11 214	0,38
HONG KONG				
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES				
Universe Trek Ltd.				
0,000 % éch. 15/06/2026 (b)	$	800	701	0,02
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Bank of East Asia Ltd.				
4,875 % éch. 22/04/2032 (f)		11 400	10 256	0,34
Cathay Pacific MTN Financing HK Ltd.				
4,875 % éch. 17/08/2026		7 250	6 943	0,23
Fortune Star BVI Ltd.				
3,950 % éch. 02/10/2026	€	22 824	14 004	0,47
4,350 % éch. 06/05/2023		16 414	16 160	0,54
5,000 % éch. 18/05/2026	$	22 100	15 166	0,51
5,050 % éch. 27/01/2027		800	515	0,02
5,950 % éch. 19/10/2025		15 200	11 764	0,39
Gemdale Ever Prosperity Investment Ltd.				
4,950 % éch. 12/08/2024		8 305	7 126	0,24
GLP China Holdings Ltd.				
2,950 % éch. 29/03/2026		10 250	7 358	0,25
Huarong Finance Co. Ltd.				
3,625 % éch. 30/09/2030		6 700	5 142	0,17
3,875 % éch. 13/11/2029		14 400	11 394	0,38
4,500 % éch. 29/05/2029		14 900	12 381	0,42
4,625 % éch. 03/06/2026		3 300	2 916	0,10
4,875 % éch. 22/11/2026		12 480	11 174	0,37
6,007 % éch. 24/02/2025		4 600	4 336	0,15
Lenovo Group Ltd.				
5,831 % éch. 27/01/2028		4 000	3 864	0,13
5,875 % éch. 24/04/2025		10 000	9 745	0,33

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Yanlord Land HK Co. Ltd.			
5,125 % éch. 20/05/2026	$ 36 999	$30 940	1,04
		181 184	6,08
Total Hong Kong		181 885	6,10
INDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Adani Green Energy Ltd.			
4,375 % éch. 08/09/2024	4 800	4 368	0,15
Adani Green Energy UP Ltd.			
6,250 % éch. 10/12/2024	12 041	11 764	0,39
GMR Hyderabad International Airport Ltd.			
4,250 % éch. 27/10/2027	9 878	8 570	0,29
4,750 % éch. 02/02/2026	25 175	23 546	0,79
JSW Hydro Energy Ltd.			
4,125 % éch. 18/05/2031	19 160	15 998	0,54
JSW Steel Ltd.			
5,050 % éch. 05/04/2032	2 100	1 661	0,06
5,950 % éch. 18/04/2024	1 000	996	0,03
Muthoot Finance Ltd.			
4,400 % éch. 02/09/2023	32 662	32 178	1,08
Periama Holdings LLC			
5,950 % éch. 19/04/2026	59 600	55 840	1,87
ReNew Power Pvt Ltd.			
5,875 % éch. 05/03/2027	6 220	5 979	0,20
ReNew Wind Energy AP2			
4,500 % éch. 14/07/2028	15 188	12 763	0,43
Shriram Finance Ltd.			
4,150 % éch. 18/07/2025	6 956	6 417	0,21
4,400 % éch. 13/03/2024	12 804	12 332	0,41
Total Inde		192 412	6,45
INDONÉSIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Adaro Indonesia PT			
4,250 % éch. 31/10/2024	9 584	9 239	0,31
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT			
3,750 % éch. 30/03/2026 (f)	23 154	21 534	0,72
Bukit Makmur Mandiri Utama PT			
7,750 % éch. 10/02/2026	16 856	14 496	0,49
Cikarang Listrindo Tbk PT			
4,950 % éch. 14/09/2026	6 443	6 028	0,20
Freeport Indonesia PT			
4,763 % éch. 14/04/2027	9 200	8 878	0,30
5,315 % éch. 14/04/2032	21 800	20 105	0,68
Medco Oak Tree Pte. Ltd.			
7,375 % éch. 14/05/2026	17 800	16 977	0,57
Minejesa Capital BV			
4,625 % éch. 10/08/2030	4 700	4 137	0,14
Pakuwon Jati Tbk PT			
4,875 % éch. 29/04/2028	6 100	5 398	0,18
Saka Energi Indonesia PT			
4,450 % éch. 05/05/2024	7 900	7 560	0,25
Total Indonésie		114 352	3,84
ISRAËL			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Energean Israel Finance Ltd.			
4,875 % éch. 30/03/2026	2 800	2 599	0,09
JAPON			
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES			
ANA Holdings, Inc.			
0,000 % éch. 10/12/2031 (b)	¥ 860 000	7 064	0,24
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
West China Cement Ltd.			
4,950 % éch. 08/07/2026	$ 29 475	25 054	0,84
LUXEMBOURG			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Guara Norte SARL			
5,198 % éch. 15/06/2034	4 553	3 859	0,13

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÎLE MAURICE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
CA Magnum Holdings			
5,375 % éch. 31/10/2026	$ 31 760	$ 29 020	0,97
Greenko Dutch BV			
3,850 % éch. 29/03/2026	8 977	7 810	0,26
Greenko Investment Co.			
4,875 % éch. 16/08/2023	24 932	24 464	0,82
Greenko Mauritius Ltd.			
6,250 % éch. 21/02/2023	1 820	1 813	0,06
Greenko Solar Mauritius Ltd.			
5,550 % éch. 29/01/2025	4 900	4 624	0,15
5,950 % éch. 29/07/2026	24 600	22 540	0,76
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.			
5,500 % éch. 06/04/2025	45 700	42 908	1,44
India Airport Infra			
6,250 % éch. 25/10/2025	2 400	2 300	0,08
India Clean Energy Holdings			
4,500 % éch. 18/04/2027	7 950	6 284	0,21
India Green Energy Holdings			
5,375 % éch. 29/04/2024	32 073	30 878	1,04
India Green Power Holdings			
4,000 % éch. 22/02/2027	23 702	20 304	0,68
India Toll Roads			
5,500 % éch. 19/08/2024	23 043	22 292	0,75
Total Île Maurice		215 237	7,22
MEXIQUE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banco Mercantil del Norte S.A.			
5,875 % éch. 24/01/2027 (d)(f)	8 050	7 193	0,24
6,625 % éch. 24/01/2032 (d)(f)	4 650	3 859	0,13
Total Mexique		11 052	0,37
MONGOLIE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement mongol			
4,450 % éch. 07/07/2031	9 925	7 743	0,26
5,125 % éch. 07/04/2026	22 095	19 114	0,64
5,625 % éch. 01/05/2023	12 030	11 750	0,40
Total Mongolie		38 607	1,30
PAYS-BAS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Mong Duong Finance Holdings BV			
5,125 % éch. 07/05/2029	28 359	23 646	0,79
Prosus NV			
4,193 % éch. 19/01/2032	15 600	12 954	0,44
4,987 % éch. 19/01/2052	24 000	17 030	0,57
Total Pays-Bas		53 630	1,80
OMAN			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement omanais			
7,000 % éch. 25/01/2051	5 000	4 851	0,16
PAKISTAN			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement pakistanais			
6,000 % éch. 08/04/2026	62 171	25 024	0,84
6,875 % éch. 05/12/2027	51 157	20 275	0,68
7,375 % éch. 08/04/2031	25 300	9 108	0,30
8,250 % éch. 15/04/2024	6 500	3 542	0,12
8,250 % éch. 30/09/2025	6 635	3 212	0,11
8,875 % éch. 08/04/2051	11 200	3 948	0,13
Total Pakistan		65 109	2,18
PHILIPPINES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
ACEN Finance Ltd.			
4,000 % éch. 08/03/2025 (d)	15 900	10 445	0,35
Development Bank of the Philippines			
2,375 % éch. 11/03/2031	9 252	6 996	0,23

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Globe Telecom, Inc.			
3,000 % éch. 23/07/2035	$ 15 850	$ 11 537	0,39
4,200 % éch. 02/08/2026 (d)	24 100	21 630	0,73
ICTSI Treasury BV			
3,500 % éch. 16/11/2031	2 000	1 545	0,05
Petron Corp.			
5,950 % éch. 19/04/2026 (d)	5 200	4 467	0,15
Royal Capital BV			
4,875 % éch. 05/05/2024 (d)	10 571	10 170	0,34
5,000 % éch. 05/02/2026 (d)	900	838	0,03
San Miguel Corp.			
5,500 % éch. 29/07/2025 (d)	10 150	8 894	0,30
SMC Global Power Holdings Corp.			
5,450 % éch. 09/12/2026 (d)	9 875	6 616	0,22
5,700 % éch. 21/01/2026 (d)	3 754	2 684	0,09
5,950 % éch. 05/05/2025 (d)	9 000	6 615	0,22
7,000 % éch. 21/10/2025 (d)	16 884	12 916	0,43
Total Philippines		105 353	3,53
SINGAPOUR			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
ABJA Investment Co. Pte. Ltd.			
5,450 % éch. 24/01/2028	7 650	7 477	0,25
Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.			
4,250 % éch. 25/03/2027	7 115	6 184	0,21
Continuum Energy Levanter Pte. Ltd.			
4,500 % éch. 09/02/2027	3 643	3 274	0,11
GLP Pte Ltd.			
4,500 % éch. 17/05/2026 (d)	13 300	6 825	0,23
4,600 % éch. 29/06/2027 (d)	7 000	3 605	0,12
Indika Energy Capital Pte. Ltd.			
8,250 % éch. 22/10/2025	31 900	31 563	1,06
LMIRT Capital Pte. Ltd.			
7,250 % éch. 19/06/2024	5 600	3 955	0,13
7,500 % éch. 09/02/2026	8 500	5 164	0,18
Medco Bell Pte. Ltd.			
6,375 % éch. 30/01/2027	24 100	21 825	0,73
Medco Platinum Road Pte. Ltd.			
6,750 % éch. 30/01/2025	1 802	1 758	0,06
Theta Capital Pte. Ltd.			
6,750 % éch. 31/10/2026	3 800	2 471	0,08
TML Holdings Pte. Ltd.			
4,350 % éch. 09/06/2026	14 700	13 156	0,44
5,500 % éch. 03/06/2024	9 100	8 861	0,30
Total Singapour		116 118	3,90
CORÉE DU SUD			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Kyobo Life Insurance Co. Ltd.			
5,900 % éch. 15/06/2052	2 800	2 597	0,09
Tongyang Life Insurance Co. Ltd.			
5,250 % éch. 22/09/2025 (d)	4 200	3 381	0,11
Total Corée du Sud		5 978	0,20
SRI LANKA			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement du Sri Lanka			
5,750 % éch. 18/04/2023 ^	19 512	6 194	0,21
6,200 % éch. 11/05/2027 ^	23 800	7 594	0,25
6,350 % éch. 28/06/2024 ^	9 500	3 028	0,10
6,750 % éch. 18/04/2028 ^	7 000	2 242	0,08
6,825 % éch. 18/07/2026 ^	4 500	1 441	0,05
6,850 % éch. 14/03/2024 ^	61 971	19 739	0,66
6,850 % éch. 03/11/2025 ^	39 900	12 872	0,43
7,550 % éch. 28/03/2030 ^	8 350	2 664	0,09
7,850 % éch. 14/03/2029 ^	3 600	1 153	0,04
Total Sri Lanka		56 927	1,91
THAÏLANDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Bangkok Bank PCL			
5,000 % éch. 23/09/2025 (d)(f)	3 000	2 849	0,09
Kasikornbank PCL			
3,343 % éch. 02/10/2031 (f)	6 144	5 414	0,18
4,000 % éch. 10/02/2027 (d)(f)	4 700	3 866	0,13
5,275 % éch. 14/10/2025 (d)(f)	35 657	33 585	1,13

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

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Krung Thai Bank PCL			
4,400 % éch. 25/03/2026 (d)(f)	$ 18 800	$ 16 732	0,56
Muang Thai Life Assurance PCL			
3,552 % éch. 27/01/2037 (f)	23 300	19 655	0,66
Total Thaïlande		82 101	2,75
ROYAUME-UNI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Barclays PLC			
8,000 % éch. 15/03/2029 (d)(f)	2 500	2 344	0,08
HSBC Holdings PLC			
6,000 % éch. 22/05/2027 (d)(f)	12 700	11 688	0,39
Jaguar Land Rover Automotive PLC			
4,500 % éch. 01/10/2027	6 200	4 733	0,16
NatWest Group PLC			
4,600 % éch. 28/06/2031 (d)(f)	3 000	2 155	0,07
8,000 % éch. 10/08/2025 (d)(f)	5 800	5 719	0,19
Standard Chartered PLC			
6,000 % éch. 26/07/2025 (d)(f)	7 900	7 619	0,26
7,750 % éch. 02/04/2023 (d)(f)	5 400	5 371	0,18
7,750 % éch. 15/08/2027 (d)(f)	26 300	26 058	0,87
7,776 % éch. 16/11/2025	1 300	1 340	0,05
Vedanta Resources Finance PLC			
8,950 % éch. 11/03/2025	62 292	42 394	1,42
Total Royaume-Uni		109 421	3,67
ÉTATS-UNIS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Stillwater Mining Co.			
4,000 % éch. 16/11/2026	2 500	2 211	0,07
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Obligations du Trésor américain			
1,875 % éch. 15/11/2051	2 700	1 711	0,06
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (c)			
0,125 % éch. 15/01/2032	49 017	42 971	1,44
		44 682	1,50
Total États-Unis		46 893	1,57
VIETNAM			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Vietnam Debt & Asset Trading Corp.			
1,000 % éch. 10/10/2025	$ 6 290	$ 5 258	0,18
Obligation internationale du gouvernement vietnamien			
5,500 % éch. 12/03/2028	960	936	0,03
Total Vietnam		6 194	0,21
ÎLES VIERGES BRITANNIQUES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
1MDB Global Investments Ltd.			
4,400 % éch. 09/03/2023	66 800	65 402	2,19
CAS Capital Ltd.			
4,000 % éch. 12/07/2026 (d)	3 820	2 989	0,10
Celestial Miles Ltd.			
5,750 % éch. 31/01/2024 (d)	17 554	16 852	0,56
Champion Path Holdings Ltd.			
4,500 % éch. 27/01/2026	7 200	6 287	0,21
4,850 % éch. 27/01/2028	6 939	5 854	0,20
Easy Tactic Ltd. (7,500 % en numéraire ou 7,500 % de rémunération en nature)			
7,500 % éch. 11/07/2027 (a)	28 570	6 285	0,21
7,500 % éch. 11/07/2028 (a)	8 550	1 731	0,06
NWD Finance BVI Ltd.			
4,125 % éch. 10/03/2028 (d)	11 200	8 232	0,28
4,800 % éch. 09/09/2023 (d)	17 000	10 396	0,35
5,250 % éch. 22/03/2026 (d)	38 700	33 669	1,13
6,150 % éch. 16/03/2025 (d)	57 200	53 614	1,80
Peak RE BVI Holding Ltd.			
5,350 % éch. 28/10/2025 (d)	7 670	6 262	0,21
RKPF Overseas Ltd.			
5,125 % éch. 26/07/2026	8 750	6 278	0,21
5,200 % éch. 12/01/2026	26 100	18 861	0,63
6,000 % éch. 04/09/2025	11 006	8 915	0,30
Scenery Journey Ltd.			
11,500 % éch. 24/10/2022 ^	400	27	0,00
Studio City Finance Ltd.			
5,000 % éch. 15/01/2029	20 100	14 869	0,50
6,000 % éch. 15/07/2025	24 332	21 135	0,71
6,500 % éch. 15/01/2028	2 267	1 764	0,06
Wanda Properties International Co. Ltd.			
7,250 % éch. 29/01/2024	$ 3 100	$ 2 805	0,09
Wanda Properties Overseas Ltd.			
6,875 % éch. 23/07/2023	1 000	955	0,03
Total Îles Vierges britanniques		293 182	9,83
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BILLETS À COURT TERME			
Yango Justice International Ltd.			
10,250 % éch. 15/09/2022 ^	4 500	146	0,01
Total des Instruments à court terme		146	0,01
Total des valeurs mobilières		**$ 2 652 171**	**88,95**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	22 628 495	225 244	7,56
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (e)	744 048	9 911	0,33
		235 155	7,89
FONDS INDICIELS COTÉS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)	48 700	4 824	0,16
Total Fonds d'investissement		**$ 239 979**	**8,05**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux directeur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Accords de mise en pension, à la valeur	Produits des accords de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
SSB	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 20 572	Billets du Trésor américain 1,875 % échéance 30/06/2026	$ (20 983)	$ 20 572	$ 20 574	0,69
Total des contrats de mise en pension						**$ (20 983)**	**$ 20 572**	**$ 20 574**	**0,69**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	À découvert	03/2023	102	$ 413	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Longue	03/2023	1 495	(400)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Longue	03/2023	16	(39)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Longue	03/2023	429	(377)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	À découvert	03/2023	18	4	0,00
				$ (399)	(0,01)
Total des instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé				**$ (399)**	**(0,01)**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant du notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20/12/2024	€ 5 000	$ 203	0,01
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20/06/2026	2 800	(542)	(0,02)
				$ (339)	(0,01)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant du notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice iTraxx Asia Ex-Japan 38 à 5 ans	1,000 %	20/12/2027	$ 47 907	$ 984	0,03

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	INR-MIBOR Compounded-OIS 1 jour	6,250 %	21/12/2027	INR 5 428 600	$ 454	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2027	$ 30 000	(3 068)	(0,10)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/06/2032	33 200	5 296	0,19
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,500	15/12/2031	28 100	1 899	0,06
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024	114 000	(3 136)	(0,11)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/12/2051	39 300	4 265	0,14
À recevoir	CNY-CNREPOFIX 3 mois	2,500	16/03/2027	CNY 271 400	434	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,750	16/06/2031	$ 19 400	2 832	0,09
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	15/12/2026	37 550	4 055	0,14
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028	€ 4 000	190	0,01
					$ 13 221	0,45
Total des instruments financiers dérivés compensés					**$ 13 866**	**0,47**

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

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

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

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

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant du notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie Saoudite	(1,000) %	20/12/2027	$ 49 200	$ (577)	$ (282)	$ (859)	(0,03)
BRC	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/12/2027	22 500	(460)	(10)	(470)	(0,02)
GST	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/12/2027	35 000	(377)	(355)	(732)	(0,02)
JPM	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/12/2027	22 500	(466)	(5)	(471)	(0,02)
					$ (1 880)	$ (652)	$ (2 532)	(0,09)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[2]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant du notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Longfor Group Holdings Ltd.	1,000 %	20/06/2026	$ 9 500	$ (155)	$ (1 144)	$ (1 299)	(0,04)
BRC	BOC Aviation Ltd.	1,000	20/06/2026	24 300	(70)	(6)	(76)	0,00
	Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.	1,000	20/06/2026	7 400	9	(454)	(445)	(0,02)
CBK	Obligation internationale du gouvernement vietnamien	1,000	20/12/2027	9 100	(263)	98	(165)	(0,01)
					$ (479)	$ (1 506)	$ (1 985)	(0,07)

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

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

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

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	CNH	714 240	$	110 683	$ 7 322	$ 0	$ 7 322	0,25
	02/2023	$	110 572	CNH	714 240	0	(6 952)	(6 952)	(0,23)
	02/2023		11 140	€	10 510	109	0	109	0,00
BPS	01/2023	THB	98	$	3	0	0	0	0,00
	01/2023	$	109 226	CNH	714 240	0	(5 864)	(5 864)	(0,20)
	01/2023		1	SGD	2	0	0	0	0,00
	02/2023	€	48 608	$	50 403	0	(1 623)	(1 623)	(0,05)
	02/2023	IDR	480 113		31	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	$	16 568	¥	2 171 055	0	(22)	(22)	0,00
	03/2023	MYR	581	$	129	0	(5)	(5)	0,00
	03/2023	TWD	8 606		285	3	0	3	0,00
	03/2023	$	97	INR	8 076	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	CNH	70	$	10	0	0	0	0,00
	01/2023	SGD	101		75	0	0	0	0,00
	01/2023	$	10 988	CNH	76 617	99	0	99	0,00
CBK	01/2023		73	PHP	4 072	0	0	0	0,00
	02/2023	AUD	11 101	$	7 431	0	(110)	(110)	0,00
DUB	01/2023	$	29 451	THB	1 022 256	107	0	107	0,00
	02/2023		11 683	¥	1 605 856	555	0	555	0,02
GLM	01/2023	HKD	12 085	$	1 552	3	0	3	0,00
	01/2023	THB	44 934		1 289	0	(10)	(10)	0,00
	01/2023	$	11 432	CNH	79 525	75	0	75	0,00
JPM	01/2023		1 797	CNY	12 509	14	0	14	0,00
	02/2023	AUD	20	$	13	0	0	0	0,00
	02/2023	IDR	829 259		53	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	¥	859 767		6 239	0	(314)	(314)	(0,01)
	02/2023	TWD	254 368		8 378	69	0	69	0,00
	03/2023	$	3 228	CNY	22 330	19	0	19	0,00
	03/2023		11 388	IDR	178 241 848	134	0	134	0,01
	06/2023		13 757	VND	330 164 544	13	(1)	12	0,00
MBC	01/2023	HKD	50 159	$	6 443	14	0	14	0,00
	02/2023	AUD	10		7	0	0	0	0,00
	02/2023	€	881		910	0	(33)	(33)	0,00
	03/2023	$	6 911	IDR	108 183 597	82	0	82	0,00
	05/2023	CNH	118 013	$	17 585	363	0	363	0,01
MYI	01/2023	€	182		194	0	0	0	0,00
	01/2023	£	56		68	0	0	0	0,00
	01/2023	HKD	50		6	0	0	0	0,00
	01/2023	PHP	805 025		14 389	0	(101)	(101)	0,00
	01/2023	SGD	10		8	0	0	0	0,00
	01/2023	$	232	£	193	0	0	0	0,00
	02/2023	NZD	321	$	198	0	(5)	(5)	0,00
	02/2023	TWD	470 273		15 425	63	0	63	0,00
	03/2023	$	9 719	IDR	152 428 770	134	0	134	0,01
SCX	01/2023	SGD	20	$	15	0	0	0	0,00
	01/2023	$	10	CNH	69	0	0	0	0,00
	02/2023	IDR	872 563	$	55	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	$	1 507	€	1 455	50	0	50	0,00
	03/2023	MYR	601	$	133	0	(5)	(5)	0,00
UAG	02/2023	CNH	714 240		111 084	7 464	0	7 464	0,25
	02/2023	IDR	1 295 032		82	0	(2)	(2)	0,00
						$ 16 692	$ (15 050)	$ 1 642	0,06

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en AUD (couverte) de distribution et Investisseurs en AUD (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$ 42 949	AUD 63 757	$ 299	$ 0	$ 299	0,01
BOA	01/2023	2 340	3 467	12	0	12	0,00
CBK	01/2023	AUD 22	$ 15	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 3 235	AUD 4 770	14	(14)	0	0,00
MBC	01/2023	18 517	27 475	144	(25)	119	0,00
MYI	01/2023	38 049	56 659	384	0	384	0,01
UAG	01/2023	27 728	41 079	137	0	137	0,01
				$ 990	$ (39)	$ 951	0,03

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de distribution, E en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 2 361	CHF 2 231	$ 53	$ 0	$ 53	0,00
BRC	01/2023	56	52	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	4 535	4 285	99	0	99	0,01
MBC	01/2023	CHF 13	$ 14	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	6	6	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 428	CHF 402	7	0	7	0,00
SCX	01/2023	CHF 43	$ 47	0	0	0	0,00
				$ 159	$ 0	$ 159	0,01

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de distribution, E en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	€ 8 046	$ 8 502	$ 0	$ (88)	$ (88)	0,00
	01/2023	$ 56 509	€ 54 352	1 523	0	1 523	0,05
BOA	01/2023	€ 210	$ 222	0	(3)	(3)	0,00
BPS	01/2023	15 606	16 652	0	(10)	(10)	0,00
CBK	01/2023	5 211	5 540	0	(24)	(24)	0,00
	01/2023	$ 149 671	€ 144 189	4 280	0	4 280	0,14
DUB	01/2023	13 949	13 426	386	0	386	0,01
MBC	01/2023	€ 3 933	$ 4 149	1	(50)	(49)	0,00
	01/2023	$ 213 195	€ 203 362	3 936	0	3 936	0,13
SCX	01/2023	181 207	174 095	4 676	0	4 676	0,16
				$ 14 802	$ (175)	$ 14 627	0,49

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de Capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 474	$ 581	$ 11	$ 0	$ 11	0,00
	01/2023	$ 16 409	£ 13 611	0	(34)	(34)	0,00
BRC	01/2023	£ 776	$ 943	9	0	9	0,00
	01/2023	$ 4	£ 4	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	£ 510	$ 621	7	0	7	0,00
	01/2023	$ 14 167	£ 11 821	60	(5)	55	0,00
MYI	01/2023	£ 579	$ 708	12	0	12	0,00
	01/2023	$ 711	£ 579	0	(15)	(15)	0,00
UAG	01/2023	£ 172	$ 211	5	0	5	0,00
	01/2023	$ 11 827	£ 9 844	16	(1)	15	0,00
				$ 120	$ (55)	$ 65	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Investisseurs en RMB (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BRC	01/2023	$ 488	CNH 3 445	$ 11	$ 0	$ 11	0,00
GLM	01/2023	96	677	2	0	2	0,00
MBC	01/2023	CNH 69	$ 10	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 591	CNH 4 224	20	0	20	0,00
UAG	01/2023	CNH 49	$ 7	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 612	CNH 4 323	13	0	13	0,00
				$ 46	$ 0	$ 46	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de distribution, Investisseurs en SGD (couverte) de distribution, E en SGD (couverte) de distribution et M Détail en SGD (couverte) de distribution II :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 6 180	SGD 8 478	$ 142	$ 0	$ 142	0,01
BPS	01/2023	6 084	8 347	141	0	141	0,01
GLM	01/2023	1 593	2 172	26	0	26	0,00
MBC	01/2023	SGD 327	$ 241	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	$ 6 028	SGD 8 239	116	0	116	0,00
UAG	01/2023	SGD 27	$ 20	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 295	SGD 401	4	0	4	0,00
				$ 429	$ (3)	$ 426	0,02
Total des instruments financiers dérivés hors cote						**$ 13 399**	**0,45**
Total des investissements						**$ 2 939 588**	**98,60**
Autres actifs et passifs à court terme						**$ 41 804**	**1,40**
Actif net						**$ 2 981 392**	**100,00**

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à rémunération en nature.

(b) Titres à coupon zéro.

(c) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

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

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titre convertible conditionnel.

(g) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,08 %) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Flourish Century	6,600 %	04/02/2049	25/08/2021 - 27/08/2021	$ 10 747	$ 1 209	0,04

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 46 847 $) et un montant en numéraire de 0 $ (31 décembre 2021 : 440 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 21 668 $ (31 décembre 2021 : 28 684 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 1 804 $) et un montant en numéraire de 12 646 $ (31 décembre 2021 : 10 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Mesures de la juste valeur[1]

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

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

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 0	$ 2 901 911	$ 0	$ 2 901 911
Fonds d'investissement	330 471	0	0	330 471
Contrats de mise en pension	0	178 712	0	178 712
Instruments financiers dérivés[3]	323	13 276	30	13 629
Totaux	**$ 330 794**	**$ 3 093 899**	**$ 30**	**$ 3 424 723**

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

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

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

Garantie (reçue)/nantie d'instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ 1 734	$ (1 360)	$ 374	$ S/O	$ S/O	$ S/O
BOA	(199)	350	151	1 576	(1 520)	56
BPS	(8 680)	9 734	1 054	(1 165)	1 312	147
BRC	(872)	1 172	300	2 544	(1 580)	964
CBK	4 080	(4 046)	34	575	(843)	(268)
DBL	S/O	S/O	S/O	142	0	142
DUB	1 048	(1 010)	38	14	0	14
GLM	96	0	96	2 670	(2 210)	460
GST	(732)	660	(72)	(268)	502	234
HUS	S/O	S/O	S/O	384	(580)	(196)
JPM	(538)	730	192	40	0	40
MBC	4 627	(4 030)	597	S/O	S/O	S/O

Contrepartie	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
MYI	$ 479	$ (240)	$ 239	$ 844	$ (680)	$ 164
SCX	4 720	(4 520)	200	2 530	(1 460)	1 070
UAG	7 636	(8 540)	(904)	621	(280)	341

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

Informations comparatives

Ce qui suit est une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières négociables admises à la cote sur une Bourse officielle	70,88	62,61
Valeurs mobilières négociables négociées sur un autre marché réglementé	18,07	22,44
Fonds d'investissement	8,05	9,69
Contrats de mise en pension	0,69	5,24
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,01)	0,02
Instruments financiers dérivés compensés	0,47	0,07
Instruments financiers dérivés hors cote	0,45	0,31
Contrats de prise en pension	S/O	(1,43)

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Australie	1,12	0,59
Brésil	0,13	0,54
Îles Caïmans	26,52	24,32
Chine	1,91	6,86
Égypte	S/O	0,32
France	0,59	0,10
Allemagne	0,38	0,43
Hong Kong	6,10	5,27
Inde	6,45	6,84
Indonésie	3,84	4,06
Israël	0,09	0,12
Italie	S/O	0,37
Japon	0,24	0,53
Jersey, Îles anglo-normandes	0,84	0,21
Luxembourg	0,13	0,42
Malaisie	S/O	0,81
Île Maurice	7,22	3,62
Mexique	0,37	0,41
Mongolie	1,30	1,23
Maroc	S/O	0,18
Pays-Bas	1,80	0,56
Oman	0,16	0,39
Pakistan	2,18	3,35
Philippines	3,53	2,52
Singapour	3,90	3,59
Afrique du Sud	S/O	0,35
Corée du Sud	0,20	0,13
Espagne	S/O	0,24
Sri Lanka	1,91	2,17
Suède	S/O	0,01
Thaïlande	2,75	2,07
Royaume-Uni	3,67	3,78
États-Unis	1,57	0,50
Vietnam	0,21	0,17
Îles Vierges britanniques	9,83	7,05
Instruments à court terme	0,01	0,94
Fonds d'investissement	8,05	9,69
Contrats de mise en pension	0,69	5,24
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,01)	0,02
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	(0,01)	0,00
Swaps de défaillance de crédit sur indices de crédit - vente de protection	0,03	0,03
Swaps de taux d'intérêt	0,45	0,04
Instruments financiers dérivés hors cote		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — achat de protection	(0,09)	S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	(0,07)	(0,01)
Swaps de taux d'intérêt	S/O	0,01
Swaps de rendement total sur titres	S/O	0,00
Contrats de change à terme	0,06	0,03
Contrats de change à terme couverts	0,55	0,28
Autres actifs et passifs courants	1,40	(0,38)
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES NÉGOCIABLES				
AUSTRALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Emeco Pty. Ltd.				
6,250 % éch. 10/07/2026	AUD	1 300	$ 808	0,26
Mineral Resources Ltd.				
8,000 % éch. 01/11/2027	$	1 000	1 024	0,33
8,125 % éch. 01/05/2027		1 105	1 115	0,35
Pacific National Finance Pty. Ltd.				
4,750 % éch. 22/03/2028		1 700	1 510	0,48
Santos Finance Ltd.				
3,649 % éch. 29/04/2031		600	478	0,15
5,250 % éch. 13/03/2029		400	367	0,12
Woodside Finance Ltd.				
3,700 % éch. 15/09/2026		1 600	1 498	0,48
Total Australie			6 800	2,17
BRÉSIL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
CSN Resources S.A.				
4,625 % éch. 10/06/2031		400	317	0,10
ÎLES CAÏMANS				
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES				
Hansoh Pharmaceutical Group Co. Ltd.				
0,000 % éch. 22/01/2026 (a)		900	835	0,27
Meituan				
0,000 % éch. 27/04/2027 (a)		400	347	0,11
0,000 % éch. 27/04/2028 (a)		500	422	0,13
Vnet Group, Inc.				
0,000 % éch. 01/02/2026 (a)		1 400	1 148	0,36
Zhongsheng Group Holdings Ltd.				
0,000 % éch. 21/05/2025 (a)	HKD	3 000	437	0,14
			3 189	1,01
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AAC Technologies Holdings, Inc.				
2,625 % éch. 02/06/2026	$	400	326	0,10
3,000 % éch. 27/11/2024		1 700	1 565	0,50
3,750 % éch. 02/06/2031		800	596	0,19
Agile Group Holdings Ltd.				
7,875 % éch. 31/07/2024 (c)		1 600	397	0,13
8,375 % éch. 04/12/2023 (c)		700	177	0,06
Alibaba Group Holding Ltd.				
2,125 % éch. 09/02/2031		1 000	799	0,25
2,700 % éch. 09/02/2041		1 100	705	0,22
4,500 % éch. 28/11/2034		900	811	0,26
Baidu, Inc.				
4,375 % éch. 29/03/2028		1 000	938	0,30
China Evergrande Group				
10,000 % éch. 11/04/2023 ^		500	36	0,01
China Hongqiao Group Ltd.				
6,250 % éch. 08/06/2024		1 400	1 310	0,42
China Modern Dairy Holdings Ltd.				
2,125 % éch. 14/07/2026		2 400	2 040	0,65
China SCE Group Holdings Ltd.				
5,950 % éch. 29/09/2024		200	87	0,03
6,000 % éch. 04/02/2026		200	75	0,02
7,000 % éch. 02/05/2025		600	240	0,08
CIFI Holdings Group Co. Ltd.				
4,450 % éch. 17/08/2026 ^		100	26	0,01
4,800 % éch. 17/05/2028 ^		700	190	0,06
5,250 % éch. 13/05/2026 ^		500	132	0,04
5,950 % éch. 20/10/2025 ^		1 800	476	0,15
6,000 % éch. 16/07/2025 ^		200	53	0,02
Country Garden Holdings Co. Ltd.				
2,700 % éch. 12/07/2026		200	115	0,04
3,125 % éch. 22/10/2025		400	245	0,08
3,875 % éch. 22/10/2030		1 500	797	0,25
4,200 % éch. 06/02/2026		800	491	0,16
4,800 % éch. 06/08/2030		1 500	802	0,26
5,125 % éch. 17/01/2025		200	135	0,04
5,125 % éch. 14/01/2027		700	406	0,13
5,625 % éch. 14/01/2030		500	267	0,08
6,150 % éch. 17/09/2025		1 700	1 117	0,36
7,250 % éch. 08/04/2026		1 900	1 213	0,39
8,000 % éch. 27/01/2024	$	200	$155	0,05
eHi Car Services Ltd.				
7,000 % éch. 21/09/2026		1 400	870	0,28
7,750 % éch. 14/11/2024		800	532	0,17
Geely Automobile Holdings Ltd.				
4,000 % éch. 09/12/2024 (c)		2 000	1 820	0,58
Goodman HK Finance				
3,000 % éch. 22/07/2030		700	583	0,19
Health & Happiness H&H International Holdings Ltd.				
5,625 % éch. 24/10/2024		2 100	1 867	0,59
Kaisa Group Holdings Ltd.				
9,375 % éch. 30/06/2024 ^		800	112	0,04
9,750 % éch. 28/09/2023 ^		200	28	0,01
10,500 % éch. 15/01/2025 ^		2 100	296	0,09
11,250 % éch. 09/04/2022 ^		500	64	0,02
11,950 % éch. 22/10/2022 ^		300	42	0,01
11,950 % éch. 12/11/2023 ^		1 200	169	0,05
KWG Group Holdings Ltd.				
5,875 % éch. 10/11/2024		800	349	0,11
5,950 % éch. 10/08/2025		600	248	0,08
6,300 % éch. 13/02/2026		1 100	437	0,14
Longfor Group Holdings Ltd.				
3,950 % éch. 16/09/2029		400	294	0,09
4,500 % éch. 16/01/2028		400	326	0,10
Melco Resorts Finance Ltd.				
4,875 % éch. 06/06/2025		1 100	1 012	0,32
5,250 % éch. 26/04/2026		1 700	1 499	0,48
5,750 % éch. 21/07/2028		1 500	1 257	0,40
MGM China Holdings Ltd.				
4,750 % éch. 01/02/2027		1 000	886	0,28
5,250 % éch. 18/06/2025		200	188	0,06
5,375 % éch. 15/05/2024		1 000	966	0,31
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.				
5,950 % éch. 30/04/2025		400	118	0,04
6,250 % éch. 10/08/2024		1 000	310	0,10
Sands China Ltd.				
2,800 % éch. 08/03/2027		1 500	1 287	0,41
5,625 % éch. 08/08/2025		2 400	2 298	0,73
5,900 % éch. 08/08/2028		1 700	1 594	0,51
Seazen Group Ltd.				
4,450 % éch. 13/07/2025		600	423	0,13
6,000 % éch. 12/08/2024		500	393	0,12
Shui On Development Holding Ltd.				
5,500 % éch. 29/06/2026		700	566	0,18
Sunac China Holdings Ltd.				
5,950 % éch. 26/04/2024 ^		300	66	0,02
6,500 % éch. 10/01/2025 ^		200	44	0,01
6,650 % éch. 03/08/2024 ^		3 000	652	0,21
6,800 % éch. 20/10/2024 ^		800	178	0,06
7,950 % éch. 11/10/2023 ^		500	110	0,03
8,350 % éch. 19/04/2023 ^		800	176	0,06
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.				
3,750 % éch. 23/01/2023		3 600	3 596	1,15
Tencent Holdings Ltd.				
3,240 % éch. 03/06/2050		1 100	697	0,22
Times China Holdings Ltd.				
5,550 % éch. 04/06/2024		1 900	370	0,12
VLL International, Inc.				
5,750 % éch. 28/11/2024		200	189	0,06
Wynn Macau Ltd.				
4,875 % éch. 01/10/2024		2 450	2 317	0,74
5,125 % éch. 15/12/2029		500	405	0,13
5,500 % éch. 15/01/2026		2 700	2 482	0,79
5,500 % éch. 01/10/2027		400	350	0,11
5,625 % éch. 26/08/2028		300	257	0,08
Zhongsheng Group Holdings Ltd.				
3,000 % éch. 13/01/2026		1 650	1 477	0,47
			50 922	16,22
Total Îles Caïmans			54 111	17,23
CHINE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd.				
3,080 % éch. 09/12/2025 (c)		1 000	932	0,30
CNAC HK Finbridge Co. Ltd.				
3,875 % éch. 19/06/2029		3 200	2 859	0,91
Flourish Century				
6,600 % éch. 04/02/2049 ^(f)	$	1 700	$ 189	0,06
Greenland Global Investment Ltd.				
7,250 % éch. 22/01/2027		1 100	369	0,12
Midea Investment Development Co. Ltd.				
2,880 % éch. 24/02/2027		1 500	1 357	0,43
New Metro Global Ltd.				
4,625 % éch. 15/10/2025		2 140	1 503	0,48
4,800 % éch. 15/12/2024		700	543	0,17
SF Holding Investment Ltd.				
2,375 % éch. 17/11/2026		600	540	0,17
Sinopec Group Overseas Development Ltd.				
4,250 % éch. 12/09/2028		2 300	2 242	0,72
Yango Group Co. Ltd.				
6,900 % éch. 31/10/2022 ^	CNY	20 000	382	0,12
Yango Justice International Ltd.				
7,875 % éch. 04/09/2024 ^	$	700	26	0,01
Yunda Holding Investment Ltd.				
2,250 % éch. 19/08/2025		1 500	1 328	0,42
ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd.				
3,125 % éch. 16/07/2025		2 900	2 523	0,80
Total Chine			14 793	4,71
FRANCE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BNP Paribas S.A.				
9,250 % éch. 17/11/2027 (c)(e)		700	731	0,23
Société Générale S.A.				
9,375 % éch. 22/11/2027 (c)(e)		1 000	1 029	0,33
Total France			1 760	0,56
ALLEMAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BMW Finance NV				
3,440 % éch. 15/06/2024	CNY	7 000	1 009	0,32
Deutsche Bank AG				
4,500 % éch. 30/11/2026 (c)(e)	€	800	669	0,22
10,000 % éch. 01/12/2027 (c)(e)		400	442	0,14
Total Allemagne			2 120	0,68
HONG KONG				
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES				
Universe Trek Ltd.				
0,000 % éch. 15/06/2026 (a)	$	200	175	0,06
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
China Cinda Finance Ltd.				
4,750 % éch. 08/02/2028		1 000	952	0,30
Fortune Star BVI Ltd.				
3,950 % éch. 02/10/2026	€	800	491	0,16
5,000 % éch. 18/05/2026	$	700	480	0,15
5,050 % éch. 27/01/2027		1 200	772	0,25
5,950 % éch. 19/10/2025		800	619	0,20
6,850 % éch. 02/07/2024		1 700	1 471	0,47
Gemdale Ever Prosperity Investment Ltd.				
4,950 % éch. 12/08/2024		500	429	0,14
GLP China Holdings Ltd.				
2,950 % éch. 29/03/2026		900	646	0,20
4,974 % éch. 26/02/2024		400	351	0,11
Huarong Finance Co. Ltd.				
4,250 % éch. 07/11/2027		500	428	0,14
4,500 % éch. 29/05/2029		5 100	4 238	1,35
4,875 % éch. 22/11/2026		400	358	0,11
6,007 % éch. 24/02/2025		400	377	0,12
Lenovo Group Ltd.				
5,875 % éch. 24/04/2025		200	195	0,06
6,536 % éch. 27/07/2032		700	679	0,22
Yanlord Land HK Co. Ltd.				
5,125 % éch. 20/05/2026		2 000	1 673	0,53
6,750 % éch. 23/04/2023		200	199	0,06
			14 358	4,57

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Airport Authority Hong Kong			
2,500 % éch. 12/01/2032	$ 3 600	$ 2 969	0,94
Total Hong Kong		17 502	5,57
INDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Adani Electricity Mumbai Ltd.			
3,949 % éch. 12/02/2030	1 200	919	0,29
Adani Green Energy UP Ltd.			
6,250 % éch. 10/12/2024	2 000	1 954	0,62
Adani Transmission Step-One Ltd.			
4,000 % éch. 03/08/2026	1 600	1 429	0,46
GMR Hyderabad International Airport Ltd.			
4,250 % éch. 27/10/2027	2 800	2 429	0,77
Indian Railway Finance Corp. Ltd.			
3,570 % éch. 21/01/2032	2 100	1 807	0,58
JSW Hydro Energy Ltd.			
4,125 % éch. 18/05/2031	974	813	0,26
Muthoot Finance Ltd.			
4,400 % éch. 02/09/2023	1 000	985	0,31
Network i2i Ltd.			
5,650 % éch. 15/01/2025 (c)	200	192	0,06
NTPC Ltd.			
4,250 % éch. 26/02/2026	600	578	0,18
ONGC Videsh Ltd.			
3,750 % éch. 07/05/2023	4 100	4 075	1,30
ONGC Videsh Vankorneft Pte. Ltd.			
3,750 % éch. 27/07/2026	1 000	934	0,30
Periama Holdings LLC			
5,950 % éch. 19/04/2026	3 500	3 279	1,05
Reliance Industries Ltd.			
2,875 % éch. 12/01/2032	700	568	0,18
ReNew Power Pvt Ltd.			
5,875 % éch. 05/03/2027	2 200	2 115	0,67
Shriram Finance Ltd.			
4,150 % éch. 18/07/2025	958	884	0,28
		22 961	7,31
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Export-Import Bank of India			
2,250 % éch. 13/01/2031	1 300	1 027	0,33
Total Inde		23 988	7,64
INDONÉSIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT			
3,750 % éch. 30/03/2026 (e)	2 420	2 251	0,72
4,300 % éch. 24/03/2027 (c)(e)	450	356	0,11
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT			
4,625 % éch. 20/07/2023	3 200	3 190	1,01
Bukit Makmur Mandiri Utama PT			
7,750 % éch. 10/02/2026	1 400	1 204	0,38
Cikarang Listrindo Tbk PT			
4,950 % éch. 14/09/2026	400	374	0,12
Freeport Indonesia PT			
4,763 % éch. 14/04/2027	900	869	0,28
5,315 % éch. 14/04/2032	1 600	1 476	0,47
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT			
3,541 % éch. 27/04/2032	700	578	0,18
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT			
5,800 % éch. 15/05/2050	1 200	1 008	0,32
LLPL Capital Pte. Ltd.			
6,875 % éch. 04/02/2039	1 024	904	0,29
Medco Oak Tree Pte. Ltd.			
7,375 % éch. 14/05/2026	2 000	1 908	0,61
Minejesa Capital BV			
4,625 % éch. 10/08/2030	400	352	0,11
Pakuwon Jati Tbk PT			
4,875 % éch. 29/04/2028	200	177	0,06
Pelabuhan Indonesia Persero PT			
4,875 % éch. 01/10/2024	700	692	0,22
Pertamina Persero PT			
1,400 % éch. 09/02/2026	700	626	0,20
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia			
4,400 % éch. 06/06/2027	$ 3 200	$ 3 170	1,01
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara			
3,375 % éch. 05/02/2030	2 500	2 125	0,68
Saka Energi Indonesia PT			
4,450 % éch. 05/05/2024	700	670	0,21
		21 930	6,98
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement indonésien			
4,650 % éch. 20/09/2032	6 900	6 768	2,16
5,250 % éch. 17/01/2042	900	887	0,28
		7 655	2,44
Total Indonésie		29 585	9,42
ISRAËL			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Energean Israel Finance Ltd.			
4,875 % éch. 30/03/2026	500	464	0,15
JAPON			
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES			
ANA Holdings, Inc.			
0,000 % éch. 10/12/2031 (a)	¥ 90 000	739	0,24
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			
5,063 % éch. 12/09/2025	$ 3 100	3 080	0,98
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
4,800 % éch. 15/09/2025	3 100	3 060	0,97
		6 140	1,95
Total Japon		6 879	2,19
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
West China Cement Ltd.			
4,950 % éch. 08/07/2026	1 400	1 190	0,38
LUXEMBOURG			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Guara Norte SARL			
5,198 % éch. 15/06/2034	820	695	0,22
MALAISIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Genm Capital Labuan Ltd.			
3,882 % éch. 19/04/2031	500	373	0,12
Misc Capital Two Labuan Ltd.			
3,625 % éch. 06/04/2025	3 900	3 713	1,18
Petronas Capital Ltd.			
2,480 % éch. 28/01/2032	600	497	0,16
3,404 % éch. 28/04/2061	550	382	0,12
Petronas Energy Canada Ltd.			
2,112 % éch. 23/03/2028	900	788	0,25
		5 753	1,83
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Export-Import Bank of Malaysia Bhd.			
1,831 % éch. 26/11/2026	1 000	885	0,28
Total Malaisie		6 638	2,11
ÎLE MAURICE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
CA Magnum Holdings			
5,375 % éch. 31/10/2026	1 600	1 462	0,46
Greenko Dutch BV			
3,850 % éch. 29/03/2026	2 197	1 911	0,61
Greenko Investment Co.			
4,875 % éch. 16/08/2023	2 200	2 159	0,69
Greenko Solar Mauritius Ltd.			
5,950 % éch. 29/07/2026	1 200	1 099	0,35
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd.			
5,500 % éch. 06/04/2025	1 900	1 784	0,57
India Green Energy Holdings			
5,375 % éch. 29/04/2024	$ 6 000	$ 5 776	1,84
India Toll Roads			
5,500 % éch. 19/08/2024	250	242	0,08
Total Île Maurice		14 433	4,60
MEXIQUE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banco Mercantil del Norte S.A.			
5,875 % éch. 24/01/2027 (c)(e)	850	760	0,24
MONGOLIE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement mongol			
4,450 % éch. 07/07/2031	1 600	1 248	0,40
5,625 % éch. 01/05/2023	431	421	0,13
Total Mongolie		1 669	0,53
PAYS-BAS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Mong Duong Finance Holdings BV			
5,125 % éch. 07/05/2029	1 450	1 209	0,39
Prosus NV			
4,193 % éch. 19/01/2032	2 200	1 827	0,58
4,987 % éch. 19/01/2052	1 900	1 348	0,43
Total Pays-Bas		4 384	1,40
PAKISTAN			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement pakistanais			
6,000 % éch. 08/04/2026	2 950	1 187	0,38
6,875 % éch. 05/12/2027	3 700	1 467	0,47
7,375 % éch. 08/04/2031	200	72	0,02
Total Pakistan		2 726	0,87
PHILIPPINES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Development Bank of the Philippines			
2,375 % éch. 11/03/2031	990	748	0,24
Globe Telecom, Inc.			
3,000 % éch. 23/07/2035	600	437	0,14
4,200 % éch. 02/08/2026 (c)	900	808	0,26
SMC Global Power Holdings Corp.			
5,450 % éch. 09/12/2026 (c)	300	201	0,06
7,000 % éch. 21/10/2025 (c)	200	153	0,05
		2 347	0,75
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement philippin			
1,750 % éch. 28/04/2041	€ 1 400	1 025	0,33
3,200 % éch. 06/07/2046	$ 900	661	0,21
5,000 % éch. 13/01/2037	200	195	0,06
5,609 % éch. 13/04/2033	800	848	0,27
		2 729	0,87
Total Philippines		5 076	1,62
SINGAPOUR			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
ABJA Investment Co. Pte. Ltd.			
5,450 % éch. 24/01/2028	200	196	0,06
Indika Energy Capital Pte. Ltd.			
8,250 % éch. 22/10/2025	1 950	1 929	0,61
LMIRT Capital Pte. Ltd.			
7,500 % éch. 09/02/2026	800	486	0,16
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.			
4,250 % éch. 19/06/2024 (e)	2 100	2 074	0,66
4,602 % éch. 15/06/2032 (e)	2 900	2 784	0,89
TML Holdings Pte. Ltd.			
5,500 % éch. 03/06/2024	1 400	1 363	0,43
United Overseas Bank Ltd.			
1,750 % éch. 16/03/2031 (e)	800	708	0,23
Total Singapour		9 540	3,04

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

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CORÉE DU SUD			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Hana Bank			
3,250 % éch. 30/03/2027	$ 2 500	$ 2 332	0,74
KB Capital Co. Ltd.			
1,500 % éch. 28/10/2025	900	796	0,25
Kookmin Bank			
2,500 % éch. 04/11/2030 (e)	1 400	1 117	0,36
Kyobo Life Insurance Co. Ltd.			
5,900 % éch. 15/06/2052	400	371	0,12
LG Chem Ltd.			
2,375 % éch. 07/07/2031	2 000	1 576	0,50
Shinhan Bank Co. Ltd.			
4,000 % éch. 23/04/2029 (e)	200	179	0,06
Shinhan Card Co. Ltd.			
2,500 % éch. 27/01/2027	3 600	3 154	1,01
SK Hynix, Inc.			
2,375 % éch. 19/01/2031	1 700	1 248	0,40
Tongyang Life Insurance Co. Ltd.			
5,250 % éch. 22/09/2025 (c)	600	483	0,15
		11 256	3,59
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Korea Electric Power Corp.			
5,375 % éch. 06/04/2026	6 000	6 051	1,93
Korea Hydro & Nuclear Power Co. Ltd.			
4,250 % éch. 27/07/2027	2 000	1 927	0,61
Korea National Oil Corp.			
2,125 % éch. 18/04/2027	5 300	4 676	1,49
		12 654	4,03
Total Corée du Sud		23 910	7,62
SRI LANKA			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement du Sri Lanka			
5,750 % éch. 18/04/2023 ^	800	254	0,08
6,200 % éch. 11/05/2027 ^	1 400	447	0,14
6,350 % éch. 28/06/2024 ^	500	159	0,05
6,825 % éch. 18/07/2026 ^	500	160	0,05
6,850 % éch. 14/03/2024 ^	600	191	0,06
6,850 % éch. 03/11/2025 ^	1 976	638	0,21
7,550 % éch. 28/03/2030 ^	1 100	351	0,11
Total Sri Lanka		2 200	0,70
THAÏLANDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Bangkok Bank PCL			
4,300 % éch. 15/06/2027	3 200	3 084	0,98
GC Treasury Center Co. Ltd.			
2,980 % éch. 18/03/2031	$ 1 900	$ 1 537	0,49
5,200 % éch. 30/03/2052	400	322	0,10
Kasikornbank PCL			
5,275 % éch. 14/10/2025 (c)(e)	1 100	1 036	0,33
Minor International PCL			
2,700 % éch. 19/04/2026 (c)	800	704	0,23
Muang Thai Life Assurance PCL			
3,552 % éch. 27/01/2037 (e)	2 600	2 194	0,70
Total Thaïlande		8 877	2,83
ROYAUME-UNI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
HSBC Holdings PLC			
6,000 % éch. 22/05/2027 (c)(e)	900	828	0,26
Jaguar Land Rover Automotive PLC			
4,500 % éch. 01/10/2027	500	382	0,12
Prudential PLC			
2,950 % éch. 03/11/2033	700	574	0,18
Standard Chartered PLC			
1,822 % éch. 23/11/2025	1 400	1 280	0,41
6,000 % éch. 26/07/2025 (c)(e)	700	675	0,21
7,776 % éch. 16/11/2025	200	206	0,07
Vedanta Resources Finance PLC			
8,950 % éch. 11/03/2025	2 250	1 531	0,49
Total Royaume-Uni		5 476	1,74
ÉTATS-UNIS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
BOC Aviation USA Corp.			
1,625 % éch. 29/04/2024	800	760	0,24
DAE Funding LLC			
1,550 % éch. 01/08/2024	500	465	0,15
Hyundai Capital America			
2,750 % éch. 27/09/2026	700	627	0,20
Stillwater Mining Co.			
4,000 % éch. 16/11/2026	800	707	0,22
		2 559	0,81
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Obligations du Trésor américain			
1,875 % éch. 15/11/2051	600	380	0,12
2,250 % éch. 15/08/2049	20	14	0,01
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (b)			
0,125 % éch. 15/01/2032	4 192	3 675	1,17
Billets du Trésor américain			
3,250 % éch. 31/08/2024	6 100	5 974	1,90
		10 043	3,20
Total États-Unis		12 602	4,01
ÎLES VIERGES BRITANNIQUES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
1MDB Global Investments Ltd.			
4,400 % éch. 09/03/2023	$ 4 300	$ 4 210	1,34
Celestial Miles Ltd.			
5,750 % éch. 31/01/2024 (c)	2 300	2 208	0,70
NWD Finance BVI Ltd.			
4,800 % éch. 09/09/2023 (c)	1 600	978	0,31
5,250 % éch. 22/03/2026 (c)	2 700	2 349	0,75
Peak RE BVI Holding Ltd.			
5,350 % éch. 28/10/2025 (c)	1 300	1 061	0,34
RKPF Overseas Ltd.			
5,125 % éch. 26/07/2026	600	431	0,14
5,900 % éch. 05/03/2025	1 005	842	0,27
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.			
6,750 % éch. 24/04/2033	2 189	2 073	0,66
Studio City Co. Ltd.			
7,000 % éch. 15/02/2027	200	187	0,06
Studio City Finance Ltd.			
5,000 % éch. 15/01/2029	1 300	962	0,31
6,000 % éch. 15/07/2025	300	261	0,08
TSMC Global Ltd.			
1,750 % éch. 23/04/2028	1 800	1 525	0,48
Wheelock MTN BVI Ltd.			
2,375 % éch. 25/01/2026	1 500	1 377	0,44
Total Îles Vierges britanniques		18 464	5,88
Total des valeurs mobilières		**$ 276 959**	**88,21**
	ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)	2 885 359	28 720	9,14
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - PIMCO China Bond Fund (d)	1 880	25	0,01
		28 745	9,15
FONDS INDICIELS COTÉS			
PIMCO ETFs plc - PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d)	10 100	1 001	0,32
Total Fonds d'investissement		**$ 29 746**	**9,47**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux directeur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Accords de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
SSB	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 820	Billets du Trésor américain 1,875 % échéance 30/06/2026	$ (836)	$ 820	$ 820	0,26
Total des contrats de mise en pension						**$ (836)**	**$ 820**	**$ 820**	**0,26**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	À découvert	03/2023	6	$ 23	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	À découvert	03/2023	3	28	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	À découvert	03/2023	4	108	0,03

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Longue	03/2023	32	$ (1)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Longue	03/2023	84	(4)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Longue	03/2023	130	(235)	(0,08)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Longue	03/2023	40	3	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Longue	03/2023	53	(75)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	À découvert	03/2023	32	6	0,00
				$ (147)	(0,05)
Total des instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé				**$ (147)**	**(0,05)**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant du notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Atlantia SpA	1,000 %	20/06/2025	€ 100	$ 6	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20/06/2026	400	(78)	(0,02)
				$ (72)	(0,02)

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	INR-MIBOR Compounded-OIS 1 jour	6,250 %	21/12/2027	INR 585 400	$ 49	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	0,500	15/06/2024	$ 10 900	(305)	(0,10)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2029	17 600	553	0,18
À recevoir	CNY-CNREPOFIX à 3 mois	2,500	16/03/2027	CNY 24 900	40	0,01
À recevoir	AUD-BBR-BBSW à 6 mois	0,500	16/12/2025	AUD 800	64	0,02
					$ 401	0,13
Total des instruments financiers dérivés compensés					**$ 329**	**0,11**

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

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

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

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie Saoudite	(1,000) %	20/12/2027	$ 5 700	$ (67)	$ (33)	$ (100)	(0,03)
BRC	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/12/2027	1 000	(20)	(1)	(21)	(0,01)
					$ (87)	$ (34)	$ (121)	(0,04)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[2]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant du notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Longfor Group Holdings Ltd,	1,000 %	20/06/2026	$ 600	$ (10)	$ (72)	$ (82)	(0,03)
	Philippines Government International Bond	1,000	20/12/2027	2 700	(28)	32	4	0,00
BRC	BOC Aviation Ltd,	1,000	20/06/2026	2 000	(7)	1	(6)	0,00
CBK	Vietnam Government International Bond	1,000	20/12/2027	1 400	(41)	16	(25)	(0,01)
					$ (86)	$ (23)	$ (109)	(0,04)

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

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

(ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

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

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€ 4	$ 4	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$ 5	€ 5	0	0	0	0,00
	02/2023	¥ 88 900	$ 646	0	(31)	(31)	(0,01)
BPS	01/2023	THB 16	0	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 1	SGD 1	0	0	0	0,00
	02/2023	1 620	¥ 212 283	0	(2)	(2)	0,00
	03/2023	TWD 988	$ 33	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	$ 835	CNH 5 824	7	0	7	0,00
CBK	01/2023	1 171	€ 1 108	12	0	12	0,00
	02/2023	AUD 1 425	$ 954	0	(14)	(14)	0,00
DUB	01/2023	$ 3 243	THB 112 559	12	0	12	0,00
	02/2023	1 369	¥ 188 116	65	0	65	0,02
GLM	01/2023	HKD 334	$ 43	0	0	0	0,00
	01/2023	THB 7 389	212	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$ 869	CNH 6 045	6	0	6	0,00
JPM	01/2023	564	CNY 3 928	5	0	5	0,00
	02/2023	TWD 29 206	$ 962	8	0	8	0,00
	03/2023	$ 1 014	CNY 7 011	6	0	6	0,00
	03/2023	1 214	IDR 18 994 278	14	0	14	0,01
	06/2023	1 586	VND 38 064 888	1	0	1	0,00
MBC	01/2023	€ 3 668	$ 3 844	0	(72)	(72)	(0,02)
	01/2023	HKD 1 386	178	0	0	0	0,00
	03/2023	$ 736	IDR 11 528 542	9	0	9	0,00
	05/2023	CNH 15 911	$ 2 371	49	0	49	0,02
MYI	01/2023	€ 32	34	0	0	0	0,00
	01/2023	PHP 88 640	1 584	0	(11)	(11)	0,00
	02/2023	TWD 53 996	1 771	7	0	7	0,00
	03/2023	$ 1 036	IDR 16 243 510	14	0	14	0,01
SCX	01/2023	SGD 10	$ 7	0	0	0	0,00
UAG	02/2023	$ 23	IDR 366 568	1	0	1	0,00
				$ 216	$ (132)	$ 84	0,03

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€ 104	$ 110	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	01/2023	$ 281	€ 270	8	0	8	0,00
CBK	01/2023	€ 44	$ 47	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 33 359	€ 32 126	944	0	944	0,30
GLM	01/2023	1 320	1 272	37	0	37	0,01
MBC	01/2023	€ 440	$ 470	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 35 470	€ 33 836	656	0	656	0,21
MYI	01/2023	35	33	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	34 658	33 298	894	0	894	0,29
UAG	01/2023	€ 6	$ 6	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 918	€ 860	1	0	1	0,00
				$ 2 540	$ (1)	$ 2 539	0,81

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie en GBP (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 82	£ 68	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
MBC	01/2023	78	65	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	14	11	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	67	55	0	0	0	0,00
				$ 0	$ 0	$ 0	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de distribution et E en SGD (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 915	SGD 1 256	$ 21	$ 0	$ 21	0,01
GLM	01/2023	1 041	1 423	20	0	20	0,01

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
MBC	01/2023	SGD	15	$	11	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$	977	SGD	1 335	19	0	19	0,01
SCX	01/2023		1		2	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	SGD	11	$	8	0	0	0	(0,01)
	01/2023	$	9	SGD	12	0	0	0	0,00
						$ 60	$ 0	$ 60	0,02
Total des instruments financiers dérivés hors cote								**$ 2 453**	**0,78**
Total des investissements								**$ 310 160**	**98,78**
Autres actifs et passifs à court terme								**$ 3 827**	**1,22**
Actif net								**$ 313 987**	**100,00**

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à coupon zéro.

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

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

(d) Affilié au Fonds.

(e) Titre convertible conditionnel.

(f) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,10 %) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Flourish Century	6,600 %	04/02/2049	25/08/2021 - 27/08/2021	$ 1 676	$ 189	0,06

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 992 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 1 987 $ (31 décembre 2021 : 1 398 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un titre d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 301 $) et un montant en numéraire de 30 $ (31 décembre 2021 : 530 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Mesures de la juste valeur[1]

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

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

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 0	$ 321 481	$ 0	$ 321 481
Fonds d'investissement	33 109	0	0	33 109
Contrats de mise en pension	0	837	0	837
Instruments financiers dérivés[3]	135	574	7	716
Totaux	**$ 33 244**	**$ 322 892**	**$ 7**	**$ 356 143**

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

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

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

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

Garantie (reçue)/nantie d'instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ (103)	$ 0	$ (103)	$ 237	$ 0	$ 237
BPS	(80)	0	(80)	(398)	530	132
BRC	(20)	30	10	7	0	7
CBK	917	(820)	97	10	0	10
DBL	S/O	S/O	S/O	35	0	35
DUB	77	0	77	5	0	5
GLM	61	(250)	(189)	271	0	271
GST	S/O	S/O	S/O	(51)	0	(51)
HUS	S/O	S/O	S/O	(38)	0	(38)
JPM	34	0	34	13	0	13
MBC	661	(670)	(9)	S/O	S/O	S/O
MYI	10	(129)	(119)	65	0	65
SCX	894	(680)	214	269	0	269
UAG	2	0	2	(20)	301	281

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

Informations comparatives

Ce qui suit est une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières négociables admises à la cote sur une Bourse officielle	75,24	66,89
Valeurs mobilières négociables négociées sur un autre marché réglementé	12,97	22,16
Fonds d'investissement	9,47	9,17
Contrats de mise en pension	0,26	0,23
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,05)	0,07
Instruments financiers dérivés compensés	0,11	0,02
Instruments financiers dérivés hors cote	0,78	0,11
Contrats de prise en pension	S/O	(0,28)

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Australie	2,17	2,16
Bahamas	S/O	0,22
Brésil	0,10	0,40
Îles Caïmans	17,23	16,05
Chine	4,71	11,02
France	0,56	0,14
Allemagne	0,68	0,75
Hong Kong	5,57	6,17
Inde	7,64	6,86
Indonésie	9,42	5,98
Israël	0,15	0,14
Japon	2,19	1,89
Jersey, Îles anglo-normandes	0,38	S/O
Luxembourg	0,22	0,60
Malaisie	2,11	2,17
Île Maurice	4,60	2,61
Mexique	0,24	0,47
Mongolie	0,53	0,54
Pays-Bas	1,40	0,79
Oman	S/O	0,32
Pakistan	0,87	1,39
Philippines	1,62	2,83
Singapour	3,04	3,02
Afrique du Sud	S/O	0,47
Corée du Sud	7,62	2,67
Sri Lanka	0,70	0,74
Thaïlande	2,83	2,46
Royaume-Uni	1,74	3,25
États-Unis	4,01	1,68
Îles Vierges britanniques	5,88	6,13
Instruments à court terme	S/O	5,13
Fonds d'investissement	9,47	9,17
Contrats de mise en pension	0,26	0,23
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,05)	0,07
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	(0,02)	0,01
Swaps de défaillance de crédit sur indices de crédit - vente de protection	S/O	0,01
Swaps de taux d'intérêt	0,13	0,00

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — achat de protection	(0,04)	S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	(0,04)	(0,02)
Swaps de taux d'intérêt	S/O	0,01
Swaps de rendement total sur titres	S/O	0,01
Contrats de change à terme	0,03	0,01
Contrats de change à terme couverts	0,83	0,10
Autres actifs et passifs courants	1,22	1,35
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO Capital Securities Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES NÉGOCIABLES				
AUTRICHE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Erste Group Bank AG				
4,250 % éch. 15/10/2027 (c)(e)	€	112 200	$ 95 239	1,66
6,500 % éch. 15/04/2024 (c)(e)		10 200	10 650	0,19
Total Autriche			105 889	1,85
BELGIQUE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
KBC Group NV				
4,250 % éch. 24/10/2025 (c)(e)		72 800	67 595	1,18
4,750 % éch. 05/03/2024 (c)(e)		12 800	13 061	0,23
Total Belgique			80 656	1,41
CANADA				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Bank of Nova Scotia				
3,625 % éch. 27/10/2081 (e)(f)(g)	$	21 700	15 835	0,27
4,900 % éch. 04/06/2025 (c)(e)		27 300	26 242	0,46
Scotiabank Capital Trust				
5,650 % éch. 31/12/2056	CAD	18 216	13 291	0,23
Toronto-Dominion Bank				
8,125 % éch. 31/10/2082 (e)	$	13 000	13 552	0,24
Total Canada			68 920	1,20
ÎLES CAÏMANS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
CIFI Holdings Group Co. Ltd.				
5,250 % éch. 13/05/2026 ^		700	185	0,01
6,000 % éch. 16/07/2025 ^		300	79	0,00
Country Garden Holdings Co. Ltd.				
2,700 % éch. 12/07/2026		800	458	0,01
5,125 % éch. 17/01/2025		2 200	1 490	0,03
6,150 % éch. 17/09/2025		1 900	1 248	0,02
8,000 % éch. 27/01/2024		1 500	1 163	0,02
New Metro Global Ltd.				
6,800 % éch. 05/08/2023		200	185	0,00
Seazen Group Ltd.				
4,450 % éch. 13/07/2025		700	493	0,01
6,000 % éch. 12/08/2024		900	707	0,01
Total Îles Caïmans			6 008	0,11
CHINE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
New Metro Global Ltd.				
4,800 % éch. 15/12/2024		800	620	0,01
DANEMARK				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nykredit Realkredit A/S				
4,125 % éch. 15/04/2026 (c)(e)	€	25 600	24 997	0,44
FINLANDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nordea Bank Abp				
3,750 % éch. 01/03/2029 (c)(e)(g)	$	60 900	47 170	0,82
FRANCE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Altice France S.A.				
4,250 % éch. 15/10/2029 (g)	€	8 800	7 081	0,12
5,500 % éch. 15/10/2029 (g)	$	17 900	13 681	0,24
BNP Paribas S.A.				
2,871 % éch. 19/04/2032	$	2 100	$ 1 647	0,03
3,132 % éch. 20/01/2033		23 400	18 534	0,32
4,625 % éch. 12/01/2027 (c)(e)		38 900	32 092	0,56
4,625 % éch. 25/02/2031 (c)(e)		26 900	20 850	0,36
6,875 % éch. 06/12/2029 (c)(e)	€	55 800	59 031	1,03
7,000 % éch. 16/08/2028 (c)(e)	$	125 700	118 914	2,08
7,750 % éch. 16/08/2029 (c)(e)		56 800	56 232	0,98
9,250 % éch. 17/11/2027 (c)(e)		43 500	45 460	0,79
BPCE S.A.				
1,500 % éch. 13/01/2042 (e)	€	19 600	17 550	0,31
2,125 % éch. 13/10/2046 (e)		59 200	44 260	0,77
CGG S.A.				
8,750 % éch. 01/04/2027	$	10 000	8 010	0,14
Électricité de France S.A.				
2,625 % éch. 01/12/2027 (c)	€	12 000	10 023	0,18
2,875 % éch. 15/12/2026 (c)		33 800	29 671	0,52
5,250 % éch. 29/01/2023 (c)	$	10 000	9 978	0,17
5,625 % éch. 22/01/2024 (c)		16 700	15 811	0,28
RCI Banque S.A.				
2,625 % éch. 18/02/2030	€	36 500	34 916	0,61
Société Générale S.A.				
3,337 % éch. 21/01/2033	$	30 100	23 777	0,42
6,221 % éch. 15/06/2033 (g)		70 100	65 754	1,15
6,750 % éch. 06/04/2028 (c)(e)		44 300	39 779	0,70
7,375 % éch. 04/10/2023 (c)(e)		7 846	7 527	0,13
7,875 % éch. 18/12/2023 (c)(e)		7 300	7 244	0,13
8,000 % éch. 29/09/2025 (c)(e)		54 650	54 753	0,96
9,375 % éch. 22/11/2027 (c)(e)		15 500	15 945	0,28
Total France			758 520	13,26
ALLEMAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Commerzbank AG				
6,500 % éch. 09/10/2029 (c)(e)	€	33 800	32 615	0,57
6,500 % éch. 06/12/2032		17 900	18 861	0,33
Deutsche Bank AG				
3,729 % éch. 14/01/2032 (f)	$	30 350	22 314	0,39
3,742 % éch. 07/01/2033 (g)		49 100	34 974	0,61
4,000 % éch. 24/06/2032	€	9 000	8 523	0,15
4,500 % éch. 30/11/2026 (c)(e)		39 400	32 956	0,58
6,750 % éch. 30/10/2028 (c)(e)		17 400	16 290	0,28
10,000 % éch. 01/12/2027 (c)(e)		28 400	31 418	0,55
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen				
5,875 % éch. 23/05/2042	$	19 800	19 823	0,35
Total Allemagne			217 774	3,81
HONG KONG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Hongkong & Shanghai Banking Corp. Ltd.				
4,625 % éch. 27/01/2023 (c)(g)		10 165	7 095	0,12
IRLANDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AIB Group PLC				
5,250 % éch. 09/10/2024 (c)(e)	€	19 260	18 932	0,33
6,250 % éch. 23/06/2025 (c)(e)		43 550	43 631	0,76
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				
5,950 % éch. 15/04/2030 ^(e)	$	16 800	1 058	0,02
Bank of Ireland Group PLC				
6,000 % éch. 01/09/2025 (c)(e)	€	11 391	11 344	0,20
6,750 % éch. 01/03/2033		8 300	8 819	0,16
7,500 % éch. 19/05/2025 (c)(e)		76 500	79 556	1,39
Permanent TSB Group Holdings PLC				
13,250 % éch. 26/10/2027 (c)(e)		24 600	28 242	0,49
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.				
3,000 % éch. 19/04/2051 (g)	$	8 100	6 229	0,11
3,500 % éch. 02/05/2052 (g)		7 600	5 878	0,10
Total Irlande			203 689	3,56
ISRAËL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Bank Hapoalim B.M.				
3,255 % éch. 21/01/2032 (e)		17 000	14 701	0,26
ITALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Atlantia SpA				
1,875 % éch. 12/02/2028	€	15 800	$ 14 059	0,25
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
5,375 % éch. 18/01/2028		7 208	6 220	0,11
8,000 % éch. 22/01/2030		10 300	9 645	0,17
8,500 % éch. 10/09/2030		19 950	18 781	0,33
10,500 % éch. 23/07/2029		12 250	12 142	0,21
Intesa Sanpaolo SpA				
4,000 % éch. 23/09/2029 (g)	$	51 068	43 795	0,76
4,198 % éch. 01/06/2032 (g)		28 250	20 813	0,36
4,950 % éch. 01/06/2042		20 000	12 898	0,23
5,148 % éch. 10/06/2030	£	12 400	12 189	0,21
5,875 % éch. 01/09/2031 (c)(e)	€	23 800	20 517	0,36
7,700 % éch. 17/09/2025 (c)(e)	$	1 500	1 365	0,02
7,750 % éch. 11/01/2027 (c)(e)	€	86 000	88 780	1,55
8,248 % éch. 21/11/2033	$	36 700	37 336	0,65
UniCredit SpA				
2,569 % éch. 22/09/2026 (g)		7 850	6 959	0,12
3,127 % éch. 03/06/2032 (g)		8 100	6 106	0,11
5,459 % éch. 30/06/2035 (g)		32 929	26 818	0,47
6,625 % éch. 03/06/2023 (c)(e)	€	13 985	14 469	0,25
7,500 % éch. 03/06/2026 (c)(e)		62 585	65 125	1,14
7,830 % éch. 04/12/2023 (g)	$	20 200	20 414	0,36
Total Italie			438 431	7,66
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP				
5,844 % éch. 05/11/2031 (c)	£	66 532	81 904	1,43
HSBC Capital Funding Dollar LP				
10,176 % éch. 30/06/2030 (c)	$	3 817	4 600	0,08
Total Jersey, Îles anglo-normandes			86 504	1,51
LUXEMBOURG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
CPI Property Group S.A.				
4,875 % éch. 16/07/2025 (c)	€	21 800	11 853	0,21
4,875 % éch. 18/08/2026 (c)		17 200	9 329	0,16
Lincoln Financing SARL				
3,625 % éch. 01/04/2024		3 600	3 805	0,07
Summer BC Holdco SARL				
5,750 % éch. 31/10/2026		12 500	11 423	0,20
Total Luxembourg			36 410	0,64
MEXIQUE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Mercantil del Norte S.A.				
5,875 % éch. 24/01/2027 (c)(e)	$	10 800	9 650	0,17
6,625 % éch. 24/01/2032 (c)(e)		9 000	7 468	0,13
8,375 % éch. 14/10/2030 (c)(e)		23 900	23 733	0,41
Total Mexique			40 851	0,71
PAYS-BAS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Abertis Infraestructuras Finance BV				
2,625 % éch. 26/01/2027 (c)	€	35 800	29 651	0,52
ABN AMRO Bank NV				
4,750 % éch. 22/09/2027 (c)(e)		39 600	35 987	0,63
ASR Nederland NV				
4,625 % éch. 19/10/2027 (c)(e)		45 050	40 611	0,71
7,000 % éch. 07/12/2043		13 700	14 680	0,26
Athora Netherlands NV				
7,000 % éch. 19/06/2025 (c)(e)		34 765	36 319	0,63
Cooperatieve Rabobank UA				
3,100 % éch. 29/06/2028 (c)(e)		44 200	36 596	0,64
3,250 % éch. 29/12/2026 (c)(e)		3 000	2 738	0,05
4,375 % éch. 29/06/2027 (c)(e)		32 400	30 866	0,54
4,875 % éch. 29/06/2029 (c)(e)		41 000	37 646	0,66
de Volksbank NV				
7,000 % éch. 15/12/2027 (c)(e)		19 000	18 262	0,32
ING Groep NV				
3,875 % éch. 16/05/2027 (c)(e)	$	31 568	23 159	0,40
4,125 % éch. 24/08/2033	€	15 400	15 506	0,27
4,250 % éch. 16/05/2031 (c)(e)	$	76 000	52 345	0,92

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,252 % éch. 28/03/2033	$ 5 300	$ 4 681	0,08
4,875 % éch. 16/05/2029 (c)(e)	40 900	31 697	0,55
5,750 % éch. 16/11/2026 (c)(e)	128 600	114 225	2,00
LeasePlan Corp. NV			
7,375 % éch. 29/05/2024 (c)(e)	€ 38 900	41 246	0,72
NN Group NV			
5,250 % éch. 01/03/2043	27 800	27 610	0,48
Stichting AK Rabobank Certificaten			
6,500 % (c)	261 437	268 331	4,69
Total Pays-Bas		862 156	15,07
NORVÈGE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
DNB Bank ASA			
3,691 % éch. 28/02/2023 (c)	$ 8 980	6 129	0,11
3,716 % éch. 28/02/2023 (c)(g)	2 660	1 816	0,03
4,985 % éch. 23/02/2023 (c)(g)	18 810	12 788	0,22
Total Norvège		20 733	0,36
PORTUGAL			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banco Espirito Santo S.A.			
2,625 % éch. 08/05/2017 ^	€ 26 300	4 070	0,07
4,000 % éch. 21/01/2019 ^	11 100	1 718	0,03
4,750 % éch. 15/01/2018 ^	20 000	3 095	0,06
Total Portugal		8 883	0,16
SLOVÉNIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Nova Ljubljanska Banka d.d.			
3,400 % éch. 05/02/2030	9 200	8 148	0,14
3,650 % éch. 19/11/2029	5 900	5 289	0,09
Nova Ljubljanska Banka dd			
10,750 % éch. 28/11/2032	19 200	20 799	0,37
Total Slovénie		34 236	0,60
ESPAGNE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Abanca Corp. Bancaria S.A.			
6,000 % éch. 20/01/2026 (c)(e)	10 000	9 340	0,16
6,125 % éch. 18/01/2029	7 500	7 944	0,14
7,500 % éch. 02/10/2023 (c)(e)	13 600	14 295	0,25
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.			
6,000 % éch. 29/03/2024 (c)(e)	91 200	94 952	1,66
6,000 % éch. 15/01/2026 (c)(e)	10 000	10 199	0,18
Banco de Credito Social Cooperativo S.A.			
1,750 % éch. 09/03/2028	11 300	9 301	0,16
Banco Santander S.A.			
3,625 % éch. 21/03/2029 (c)(e)	40 000	29 724	0,52
4,125 % éch. 12/11/2027 (c)(e)(g)	50 800	43 475	0,76
4,375 % éch. 14/01/2026 (c)(e)	54 200	49 321	0,86
Bankinter S.A.			
6,250 % éch. 17/01/2026 (c)(e)	19 400	20 404	0,36
CaixaBank S.A.			
3,625 % éch. 14/09/2028 (c)(e)	56 200	42 371	0,74
5,250 % éch. 23/03/2026 (c)(e)	65 600	60 777	1,06
5,875 % éch. 09/10/2027 (c)(e)	20 400	19 999	0,35
6,750 % éch. 13/06/2024 (c)(e)	79 600	83 095	1,45
Total Espagne		495 197	8,65
SUÈDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Svenska Handelsbanken AB			
4,750 % éch. 01/03/2031 (c)(e)(g)	$ 22 600	18 560	0,33
Swedbank AB			
4,000 % éch. 17/03/2029 (c)(e)	29 000	22 457	0,39
Total Suède		41 017	0,72
SUISSE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Credit Suisse Group AG			
2,875 % éch. 02/04/2032	€ 100	77	0,00
3,091 % éch. 14/05/2032 (g)	$ 3 350	2 321	0,04
4,194 % éch. 01/04/2031 (g)	$ 60 900	$ 47 393	0,83
6,250 % éch. 18/12/2024 (c)(e)	63 390	49 975	0,87
6,375 % éch. 21/08/2026 (c)(e)	33 900	24 380	0,43
6,442 % éch. 11/08/2028 (g)	1 700	1 551	0,03
6,537 % éch. 12/08/2033 (g)	3 700	3 256	0,06
7,250 % éch. 12/09/2025 (c)(e)	22 559	16 220	0,28
7,375 % éch. 07/09/2033	£ 5 900	6 480	0,11
7,500 % éch. 17/07/2023 (c)(e)	$ 32 299	25 891	0,45
7,500 % éch. 11/12/2023 (c)(e)	16 200	14 191	0,25
9,750 % éch. 23/06/2027 (c)(e)	77 000	67 264	1,18
UBS AG			
5,125 % éch. 15/05/2024 (e)(g)	5 000	4 946	0,09
UBS Group AG			
2,746 % éch. 11/02/2033	11 570	8 971	0,16
4,375 % éch. 10/02/2031 (c)(e)(g)	58 611	44 677	0,78
4,375 % éch. 10/02/2031 (c)(e)	30 300	23 097	0,40
4,875 % éch. 12/02/2027 (c)(e)(g)	43 100	36 635	0,64
4,875 % éch. 12/02/2027 (c)(e)	42 500	36 125	0,63
7,000 % éch. 31/01/2024 (c)(e)	24 958	24 617	0,43
7,000 % éch. 19/02/2025 (c)(e)	800	794	0,01
Total Suisse		438 861	7,67
ROYAUME-UNI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Barclays PLC			
6,125 % éch. 15/12/2025 (c)(e)	68 783	62 850	1,10
6,375 % éch. 15/12/2025 (c)(e)	£ 30 764	34 022	0,59
7,125 % éch. 15/06/2025 (c)(e)	41 150	46 920	0,82
7,250 % éch. 15/03/2023 (c)(e)	21 430	25 546	0,45
7,437 % éch. 02/11/2033	$ 15 600	16 393	0,29
7,750 % éch. 15/09/2023 (c)(e)	8 700	8 516	0,15
8,000 % éch. 15/06/2024 (c)(e)	24 174	23 548	0,41
8,000 % éch. 15/03/2029 (c)(e)	40 000	37 500	0,66
8,875 % éch. 15/09/2027 (c)(e)	£ 36 200	43 030	0,75
BCP Modular Services Finance PLC			
4,750 % éch. 30/11/2028	€ 19 300	17 338	0,30
Bupa Finance PLC			
4,000 % éch. 24/09/2031 (c)(e)	£ 11 100	9 112	0,16
HSBC Bank PLC			
4,420 % éch. 31/03/2023 (c)(g)	$ 19 480	13 539	0,24
5,251 % éch. 15/06/2023 (c)(g)	8 850	6 151	0,11
5,401 % éch. 30/06/2023 (c)(g)	16 300	11 329	0,20
HSBC Holdings PLC			
4,600 % éch. 17/12/2030 (c)(e)	15 300	11 941	0,21
4,750 % éch. 04/07/2029 (c)(e)	€ 83 102	76 398	1,33
Legal & General Group PLC			
5,625 % éch. 24/03/2031 (c)(e)	£ 26 300	27 306	0,48
Lloyds Banking Group PLC			
4,947 % éch. 27/06/2025 (c)(e)	€ 61 240	62 749	1,10
5,125 % éch. 27/12/2024 (c)(e)	£ 300	333	0,01
7,500 % éch. 27/09/2025 (c)(e)	$ 25 491	24 655	0,43
7,875 % éch. 27/06/2029 (c)(e)	£ 45 613	52 558	0,92
8,500 % éch. 27/09/2027 (c)(e)	19 500	23 648	0,41
Nationwide Building Society			
5,750 % éch. 20/06/2027 (c)(e)	19 270	20 860	0,36
NatWest Group PLC			
4,445 % éch. 08/05/2030 (g)	$ 33 800	30 675	0,54
4,500 % éch. 31/03/2028 (c)(e)	£ 21 300	19 726	0,34
4,600 % éch. 28/06/2031 (c)(e)	$ 24 759	17 788	0,31
4,892 % éch. 18/05/2029 (g)	50 126	47 519	0,83
5,076 % éch. 27/01/2030 (g)	1 500	1 416	0,02
5,125 % éch. 12/05/2027 (c)(e)	£ 26 050	26 399	0,46
6,000 % éch. 29/12/2025 (c)(e)	$ 50 100	46 390	0,81
7,416 % éch. 06/06/2033	£ 17 500	21 241	0,37
Santander UK Group Holdings PLC			
2,896 % éch. 15/03/2032	$ 1 600	1 240	0,02
6,750 % éch. 24/06/2024 (c)(e)	£ 53 260	61 733	1,08
Santander UK PLC			
5,000 % éch. 07/11/2023 (g)	$ 8 753	8 783	0,15
Virgin Money UK PLC			
8,250 % éch. 17/06/2027 (c)(e)	£ 13 734	14 916	0,26
9,250 % éch. 08/06/2024 (c)(e)	27 000	32 530	0,57
		986 598	17,24
TITRES DE PRÉFÉRENCE			
Nationwide Building Society			
10,250 %	596 146	$ 89 817	1,57
Total Royaume-Uni		1 076 415	18,81
ÉTATS-UNIS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Bank of America Corp.			
1,843 % éch. 04/02/2025 (g)	$ 44 500	42 684	0,75
Deutsche Postbank Funding Trust			
2,081 % éch. 07/06/2023 (c)	€ 12 980	10 010	0,17
2,667 % éch. 02/06/2023 (c)	1 704	1 317	0,02
Doctors Co. An Interinsurance Exchange			
4,500 % éch. 18/01/2032 (g)	$ 3 400	2 740	0,05
Goldman Sachs Group, Inc.			
3,000 % éch. 15/03/2024 (g)	7 500	7 317	0,13
Liberty Mutual Group, Inc.			
3,625 % éch. 23/05/2059	€ 15 500	14 641	0,26
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.			
5,650 % éch. 01/05/2079 (g)	$ 8 224	7 486	0,13
Total États-Unis		86 195	1,51
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
3,371 % éch. 05/01/2023 (a)(b)	37 800	37 792	0,66
3,541 % éch. 24/01/2023 (a)(b)	12 800	12 771	0,22
3,544 % éch. 24/01/2023 (a)(b)	10 200	10 177	0,18
3,545 % éch. 24/01/2023 (a)(b)	29 300	29 234	0,51
3,977 % éch. 19/01/2023 (a)(b)	6 100	6 090	0,11
3,984 % éch. 19/01/2023 (a)(b)	3 000	2 995	0,05
3,986 % éch. 19/01/2023 (a)(b)	4 200	4 193	0,07
4,000 % éch. 19/01/2023 (a)(b)	3 300	3 295	0,06
4,079 % éch. 24/01/2023 (a)(b)	2 400	2 395	0,04
4,163 % éch. 16/03/2023 (a)(b)	7 000	6 942	0,12
4,191 % éch. 16/02/2023 (a)(b)	33 000	32 836	0,57
4,198 % éch. 16/03/2023 (a)(b)	11 100	11 008	0,19
4,221 % éch. 16/02/2023 (a)(b)	60 500	60 200	1,05
4,230 % éch. 16/02/2023 (a)(b)	3 200	3 184	0,06
4,250 % éch. 02/03/2023 (a)(b)	25 400	25 227	0,44
4,250 % éch. 09/03/2023 (a)(b)	19 500	19 351	0,34
4,251 % éch. 23/02/2023 (a)(b)	14 800	14 711	0,26
4,255 % éch. 23/02/2023 (a)(b)	209 700	208 440	3,64
4,273 % éch. 09/03/2023 (a)(b)	49 400	49 022	0,86
4,277 % éch. 09/03/2023 (a)(b)	2 100	2 084	0,04
4,279 % éch. 09/03/2023 (a)(b)	202 300	200 752	3,51
4,282 % éch. 02/03/2023 (a)(b)	12 100	12 017	0,21
4,291 % éch. 16/03/2023 (a)(b)	35 800	35 504	0,62
4,299 % éch. 23/03/2023 (a)(b)	23 700	23 480	0,41
4,305 % éch. 23/03/2023 (a)(b)	20 500	20 309	0,35
4,312 % éch. 23/03/2023 (a)(b)	7 200	7 133	0,12

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,317 % éch. 09/03/2023 (a)(b)	$ 33 800	$33 541	0,59
4,321 % éch. 02/03/2023 (a)(b)	39 700	39 429	0,69
4,445 % éch. 30/03/2023 (a)(b)	13 700	13 560	0,24
Total instruments à court terme		927 672	16,21
Total des valeurs mobilières		**$ 6 129 600**	**107,13**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)	14 017	$ 140	0,00
Total Fonds d'investissement		**$ 140**	**0,00**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux directeur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Accords de mise en pension, à la valeur	Produits des accords de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
FICC	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 10 172	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 29/06/2023	$ (10 375)	$ 10 172	$ 10 173	0,18
Total des contrats de mise en pension						**$ (10 375)**	**$ 10 172**	**$ 10 173**	**0,18**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars	Longue	03/2023	231	$ (356)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	À découvert	03/2023	2 626	9 852	0,17
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Longue	03/2023	724	(7 071)	(0,12)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	À découvert	03/2023	461	10 670	0,19
Contrats à terme standardisés sur obligation euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars	À découvert	03/2023	1 385	13 613	0,24
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Longue	03/2023	6 650	(36)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	À découvert	03/2023	1 655	801	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Longue	03/2023	3 048	(3 128)	(0,05)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Longue	03/2023	726	(881)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	À découvert	03/2023	1 486	2 007	0,03
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Longue	03/2023	204	(1 322)	(0,02)
				$ 24 149	0,42
Total des instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé				**$ 24 149**	**0,42**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant du notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20/06/2027	€ 20 000	$ (1 677)	(0,03)

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	GBP-SONIO Compounded-OIS 1 jour	0,750 %	15/09/2051	£ 3 800	$ 1 067	0,02
À recevoir[3]	GBP-SONIO Compounded-OIS 1 jour	2,000	15/03/2033	113 200	(1 550)	(0,03)
À recevoir[3]	GBP-SONIO Compounded-OIS 1 jour	2,000	15/03/2053	32 500	679	0,01
À recevoir[3]	GBP-SONIO Compounded-OIS 1 jour	2,250	15/03/2028	102 900	(2 054)	(0,03)
À payer[3]	GBP-SONIO Compounded-OIS 1 jour	2,500	15/03/2025	20 900	(280)	0,00
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053	€ 74 000	6 521	0,11
					$ 4 383	0,08
Total des instruments financiers dérivés compensés					**$ 2 706**	**0,05**

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

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

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

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

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant du notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Deutsche Bank AG	1,000 %	20/12/2026	€ 4 700	$ (119)	$ (132)	$ (251)	0,00
	Deutsche Bank AG	1,000	20/06/2027	24 700	(3 307)	1 646	(1 661)	(0,03)
GST	Deutsche Bank AG	1,000	20/12/2026	5 000	(129)	(139)	(268)	(0,01)
					$ (3 555)	$ 1 375	$ (2 180)	(0,04)

(1) Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

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

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	AUD	140	$	95	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BOA	01/2023	£	7 719		9 364	78	0	78	0,00
	01/2023	$	2 342	£	1 902	0	(54)	(54)	0,00
BPS	01/2023	€	5 397	$	5 759	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	$	14 826	€	13 909	24	0	24	0,00
	01/2023		4 691	£	3 889	0	(12)	(12)	0,00
BRC	01/2023	CNH	350	$	50	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	€	2 140		2 289	4	0	4	0,00
	01/2023	£	488		587	0	0	0	0,00
	01/2023	SGD	1 848		1 372	0	(6)	(6)	0,00
	01/2023	$	2 262	€	2 128	10	0	10	0,00
CBK	01/2023	CAD	902	$	667	1	0	1	0,00
	01/2023	CHF	940		996	0	(22)	(22)	0,00
	01/2023	€	504 378		522 936	0	(15 591)	(15 591)	(0,27)
	01/2023	SEK	5 705		548	0	0	0	0,00
	01/2023	$	68 127	€	64 201	421	0	421	0,01
GLM	01/2023	CNH	300	$	43	0	0	0	0,00
JPM	01/2023	$	63	CNY	436	1	0	1	0,00
	03/2023		113		778	1	0	1	0,00
MBC	01/2023	AUD	674	$	459	2	0	2	0,00
	01/2023	€	93 766		98 597	0	(1 517)	(1 517)	(0,03)
	01/2023	£	17 748		21 638	286	0	286	0,01
	01/2023	$	12 282	€	11 533	32	0	32	0,00
	01/2023		9 381	£	7 694	0	(125)	(125)	0,00
	05/2023		43	CNH	290	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01/2023	€	1 050	$	1 118	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	£	17 563		21 617	487	0	487	0,01
	01/2023	SGD	250		185	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	913	£	757	0	(2)	(2)	0,00
RBC	01/2023		1 259	CAD	1 689	0	(12)	(12)	0,00
SCX	01/2023	CAD	6 303	$	4 692	40	0	40	0,00
	01/2023	€	1 763 850		1 835 903	0	(47 369)	(47 369)	(0,83)
	01/2023	$	50	CNH	350	0	0	0	0,00
TOR	01/2023	CAD	16 022	$	11 919	93	0	93	0,00
	01/2023	£	521 409		626 884	0	(419)	(419)	(0,01)
	01/2023	$	14 850	€	13 953	48	0	48	0,00
UAG	01/2023		6 843	£	5 535	0	(184)	(184)	0,00
						$ 1 528	$ (65 322)	$ (63 794)	(1,11)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Investisseurs en AUD (couverte) de distribution et Z en AUD (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$	19 576	AUD	29 061	$ 136	$ 0	$ 136	0,00
BOA	01/2023	AUD	263	$	177	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01/2023		910		618	1	0	1	0,00
	01/2023	$	636	AUD	947	6	0	6	0,00
MBC	01/2023	AUD	60	$	41	1	0	1	0,00
	01/2023	$	10 699	AUD	15 893	93	(11)	82	0,00
MYI	01/2023		24 228		36 077	244	0	244	0,01
RBC	01/2023		3 937		5 871	46	0	46	0,00
TOR	01/2023		21 853		32 378	109	0	109	0,00
						$ 636	$ (12)	$ 624	0,01

Tableau des investissements Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en BRL (couverte) de Capitalisation:

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BPS	01/2023	BRL	1 774	$	332	$ 1	$ (5)	$ (4)	0,00
	02/2023	$	148	BRL	781	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01/2023	BRL	88 384	$	16 729	68	(80)	(12)	0,00
	01/2023	$	8 091	BRL	44 625	361	0	361	0,01
	02/2023		16 626		88 384	85	(61)	24	0,00
GLM	01/2023	BRL	43 963	$	8 302	0	(25)	(25)	(0,01)
	01/2023	$	8 316	BRL	45 655	335	(4)	331	0,01
	02/2023	BRL	51	$	10	0	0	0	0,00
	02/2023	$	8 189	BRL	43 632	30	0	30	0,00
JPM	01/2023	BRL	1 596	$	304	4	(2)	2	0,00
	01/2023	$	7 355	BRL	40 591	334	0	334	0,01
	02/2023		173		904	0	(3)	(3)	0,00
MYI	01/2023		917		4 846	1	0	1	0,00
						$ 1 219	$ (181)	$ 1 038	0,02

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Investisseurs en CAD (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	$	1 014	CAD	1 371	$ 0	$ (2)	$ (2)	0,00
CBK	01/2023	CAD	41	$	30	0	0	0	0,00
	01/2023	$	601	CAD	812	0	(2)	(2)	0,00
MBC	01/2023		1 114		1 507	0	(2)	(2)	0,00
MYI	01/2023	CAD	41	$	30	0	0	0	0,00
	01/2023	$	6	CAD	8	0	0	0	0,00
SCX	01/2023		286		385	0	(2)	(2)	0,00
						$ 0	$ (8)	$ (8)	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de Capitalisation et E en CHF (couverte) de Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	20 441	CHF	19 341	$ 477	$ 0	$ 477	0,01
CBK	01/2023	CHF	186	$	198	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	$	38 990	CHF	36 842	856	0	856	0,01
MBC	01/2023	CHF	244	$	263	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	438	CHF	409	4	0	4	0,00
MYI	01/2023	CHF	57	$	60	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	4 815	CHF	4 526	81	0	81	0,00
SCX	01/2023	CHF	27	$	29	0	0	0	0,00
	01/2023	$	28	CHF	26	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	CHF	86	$	93	0	0	0	0,00
						$ 1 418	$ (5)	$ 1 413	0,02

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Institutions en EUR (couverte) de distribution II, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution, R en EUR (couverte) de distribution et T en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€	2 726	$	2 875	$ 0	$ (36)	$ (36)	0,00
BPS	01/2023	$	6 485	€	6 078	4	0	4	0,00
CBK	01/2023	€	6 151	$	6 518	0	(49)	(49)	0,00
	01/2023	$	704 913	€	679 755	20 866	0	20 866	0,36
MBC	01/2023	€	9 302	$	9 877	1	(56)	(55)	0,00
	01/2023	$	823 442	€	785 685	15 438	0	15 438	0,27
SCX	01/2023		744 914		715 679	19 220	0	19 220	0,34
						$ 55 529	$ (141)	$ 55 388	0,97

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution, Investisseurs en GBP (couverte) de distribution et R en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£	480	$	578	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	01/2023	$	273	£	225	0	(2)	(2)	0,00
BPS	01/2023	£	4	$	5	0	0	0	0,00
BRC	01/2023		737		888	1	0	1	0,00
	01/2023	$	25	£	21	0	0	0	0,00
JPM	01/2023		43 529		36 048	0	(160)	(160)	0,00
MBC	01/2023	£	423	$	515	6	0	6	0,00
	01/2023	$	43 025	£	35 842	165	(69)	96	0,00
MYI	01/2023	£	252	$	310	7	0	7	0,00
	01/2023	$	2 073	£	1 687	0	(43)	(43)	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
TOR	01/2023	$ 43 206	£ 35 937	$ 29	$ 0	$ 29	0,00
UAG	01/2023	£ 1	$ 2	0	0	0	0,00
				$ 209	$ (274)	$ (65)	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Investisseurs en RMB (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BRC	01/2023	$ 1 349	CNH 9 527	$ 29	$ 0	$ 29	0,00
GLM	01/2023	175	1 236	4	0	4	0,00
MBC	01/2023	CNH 342	$ 50	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 1 508	CNH 10 788	52	0	52	0,00
UAG	01/2023	CNH 58	$ 8	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 1 490	CNH 10 538	34	0	34	0,00
				$ 119	$ 0	$ 119	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de distribution, Investisseurs en SGD (couverte) de distribution, Administrations en SGD (couverte) de distribution II et M Détail en SGD (couverte) de distribution II :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$ 51	SGD 69	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
BOA	01/2023	23 702	32 544	567	0	567	0,01
BPS	01/2023	27 032	37 051	597	0	597	0,01
GLM	01/2023	716	976	12	0	12	0,00
MBC	01/2023	SGD 503	$ 375	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 26 229	SGD 35 851	506	0	506	0,01
UAG	01/2023	SGD 471	$ 344	0	(7)	(7)	0,00
	01/2023	$ 925	SGD 1 253	10	0	10	0,00
				$ 1 693	$ (7)	$ 1 686	0,03

Total des instruments financiers dérivés hors cote	**$ (5 779)**	**(0,10)**
Total des investissements	**$ 6 160 988**	**107,68**
Autres actifs et passifs à court terme	**$ (439 397)**	**(7,68)**
Actif net	**$ 5 721 591**	**100,00**

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le coupon représente un rendement à échéance.

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

(d) Affilié au Fonds.

(e) Titre convertible conditionnel.

(f) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,23 %) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Bank of Nova Scotia	3,625 %	27/10/2081	29/09/2021	$ 21 700	$ 15 835	0,27
Deutsche Bank AG	3,729	14/01/2032	12/08/2022 - 17/10/2022	21 750	22 314	0,39
				$ 43 450	$ 38 149	0,66

(g) Des titres d'une juste valeur globale de 627 510 $ (31 décembre 2021 : 23 072 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 14 581 $) et un montant en numéraire de 29 992 $ (31 décembre 2021 : 14 640 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2021 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Un montant en numéraire de 18 271 $ (31 décembre 2021 : 0 $) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 80 890 $ (31 décembre 2021 : 117 977 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Tableau des investissements Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)

Mesures de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 0	$ 6 129 600	$ 0	$ 6 129 600
Fonds d'investissement	140	0	0	140
Contrats de mise en pension	0	10 172	0	10 172
Instruments financiers dérivés[3]	25 386	(4 310)	0	21 076
Totaux	**$ 25 526**	**$ 6 135 462**	**$ 0**	**$ 6 160 988**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 231 912	$ 8 191 098	$ 0	$ 8 423 010
Fonds d'investissement	481 206	0	0	481 206
Contrats de mise en pension	0	62 523	0	62 523
Instruments financiers dérivés[3]	11 041	3 107	0	14 148
Totaux	**$ 724 159**	**$ 8 256 728**	**$ 0**	**$ 8 980 887**

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

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

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

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	En % de l'actif net
BPS	2,000 %	21/12/2022	TBD[1]	€ (6 701)	$ (7 156)	(0,13)
	4,250	05/10/2022	05/01/2023	$ (30 178)	(30 491)	(0,53)
	5,480	05/01/2023	07/07/2023	(33 701)	(33 701)	(0,59)
BRC	1,200	20/09/2022	TBD[1]	€ (4 545)	(4 860)	(0,08)
BYR	4,960	05/10/2022	06/02/2023	$ (59 439)	(59 977)	(1,05)
FBF	1,500	02/11/2022	TBD[1]	€ (2 672)	(2 857)	(0,05)
IND	4,400	11/10/2022	10/02/2023	$ (13 157)	(13 289)	(0,23)
	4,400	21/10/2022	10/02/2023	(59 799)	(60 326)	(1,05)
	4,600	07/11/2022	16/02/2023	(96 816)	(97 496)	(1,70)
JML	4,163	11/10/2022	06/01/2023	(133 869)	(135 138)	(2,36)
SCX	4,190	07/10/2022	09/01/2023	(36 102)	(36 463)	(0,64)
	4,190	21/10/2022	09/01/2023	(11 741)	(11 839)	(0,21)
	4,230	11/10/2022	11/01/2023	(80 329)	(81 103)	(1,42)
	4,230	21/10/2022	11/01/2023	(3 747)	(3 779)	(0,07)
Total des contrats de prise en pension					**$ (578 475)**	**(10,11)**

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

Garantie (reçue)/nantie d'instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ 137	$ 0	$ 137	$ S/O	$ S/O	$ S/O
BOA	1 028	(1 010)	18	566	(340)	226
BPS	(1 308)	1 490	182	(24 905)	14 350	(10 555)
BRC	37	(10)	27	(7 345)	4 340	(3 005)
CBK	6 857	(6 830)	27	(240)	0	(240)
FBF	S/O	S/O	S/O	32	0	32
GLM	352	(400)	(48)	(14)	472	458
GST	(268)	262	(6)	(92)	0	(92)
HUS	S/O	S/O	S/O	1 081	(820)	261
JPM	175	(340)	(165)	(22)	290	268
MBC	14 804	(13 250)	1 554	S/O	S/O	S/O
MYI	771	(650)	121	715	(480)	235
RBC	34	0	34	9 700	(7 750)	1 950
SCX	(28 111)	26 890	(1 221)	12 393	(7 760)	4 633
SSB	S/O	S/O	S/O	(53)	80	27
TOR	(140)	1 350	1 210	10 924	(7 040)	3 884
UAG	(147)	0	(147)	(13 336)	9 689	(3 647)

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

Informations comparatives

Ce qui suit est une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières négociables admises à la cote sur une Bourse officielle	82,69	81,02
Valeurs mobilières négociables négociées sur un autre marché réglementé	24,44	11,44
Fonds d'investissement	0,00	5,28
Contrats de mise en pension	0,18	0,69
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,42	0,16
Instruments financiers dérivés compensés	0,05	0,11
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,10)	(0,12)
Contrats de prise en pension	(10,11)	(0,26)

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Autriche	1,85	1,19
Belgique	1,41	0,99
Canada	1,20	0,82
Îles Caïmans	0,11	0,06
Chine	0,01	S/O
Danemark	0,44	0,58
Finlande	0,82	0,42
France	13,26	8,34
Allemagne	3,81	2,68
Hong Kong	0,12	0,02
Irlande	3,56	2,75
Israël	0,26	0,19
Italie	7,66	7,95
Japon	S/O	0,21
Jersey, Îles anglo-normandes	1,51	1,44
Luxembourg	0,64	1,16
Mexique	0,71	0,47
Pays-Bas	15,07	13,49
Norvège	0,36	0,12
Portugal	0,16	0,13
Slovénie	0,60	0,35
Espagne	8,65	10,15
Suède	0,72	0,74
Suisse	7,67	7,68
Royaume-Uni	18,81	22,43
États-Unis	1,51	3,97
Instruments à court terme	16,21	4,13
Fonds d'investissement	0,00	5,28
Contrats de mise en pension	0,18	0,69
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,42	0,16
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	(0,03)	0,00
Swaps de défaillance de crédit sur indices de crédit — vente de protection	S/O	0,02
Swaps de taux d'intérêt	0,08	0,09
Instruments financiers dérivés hors cote		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	(0,04)	(0,01)
Contrats de change à terme	(1,11)	(0,55)
Contrats de change à terme couverts	1,05	0,44
Autres actifs et passifs courants	(7,68)	1,42
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO Climate Bond Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES NÉGOCIABLES				
AUSTRALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
GPT Wholesale Office Fund				
3,222 % éch. 05/11/2031	AUD	500	$ 263	0,09
Lendlease Finance Ltd.				
3,400 % éch. 27/10/2027		930	551	0,19
3,700 % éch. 31/03/2031		200	104	0,03
Total Australie			918	0,31
AUTRICHE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Erste Group Bank AG				
0,125 % éch. 17/05/2028	€	700	606	0,21
BELGIQUE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement belge				
2,750 % éch. 22/04/2039		700	681	0,23
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap				
3,250 % éch. 12/01/2043		500	495	0,17
Total Belgique			1 176	0,40
BRÉSIL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Suzano Austria GmbH				
3,125 % éch. 15/01/2032	$	275	215	0,07
CANADA				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
TransAlta Corp.				
7,750 % éch. 15/11/2029		300	307	0,11
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement canadien				
2,250 % éch. 01/12/2029	CAD	6 400	4 432	1,51
Total Canada			4 739	1,62
CHILI				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement chilien				
0,830 % éch. 02/07/2031	€	2 100	1 762	0,60
3,500 % éch. 15/04/2053	$	400	285	0,10
Total Chili			2 047	0,70
CHYPRE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Atrium Finance PLC				
2,625 % éch. 05/09/2027	€	1 100	823	0,28
FINLANDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
SBB Treasury Oyj				
1,125 % éch. 26/11/2029		900	616	0,21
Tornator Oyj				
1,250 % éch. 14/10/2026		200	191	0,07
Total Finlande			807	0,28
FRANCE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AXA S.A.				
5,625 % éch. 16/01/2054	£	480	543	0,19
Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.				
0,250 % éch. 29/06/2028	€	100	89	0,03
BNP Paribas S.A.				
0,500 % éch. 04/06/2026		2 900	2 843	0,97
1,675 % éch. 30/06/2027	$	500	436	0,15
4,625 % éch. 25/02/2031 (c)(d)		1 000	775	0,26
CNP Assurances				
2,000 % éch. 27/07/2050	€	200	174	0,06
4,875 % éch. 07/10/2030 (c)(d)	$	800	633	0,22
Crédit Agricole S.A.				
0,125 % éch. 09/12/2027	€	100	88	0,03
Faurecia SE				
2,375 % éch. 15/06/2029	€	1 500	$ 1 216	0,41
2,750 % éch. 15/02/2027		500	452	0,15
Île-de-France Mobilités				
0,400 % éch. 28/05/2031		800	674	0,23
SEB S.A.				
1,375 % éch. 16/06/2025		600	596	0,20
Société Générale S.A.				
0,625 % éch. 02/12/2027		1 200	1 103	0,38
Suez SACA				
4,625 % éch. 03/11/2028		700	757	0,26
Valeo				
1,000 % éch. 03/08/2028		1 200	989	0,34
5,375 % éch. 28/05/2027		200	208	0,07
Verallia S.A.				
1,625 % éch. 14/05/2028		1 300	1 199	0,41
			12 775	4,36
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Agence Française de Développement				
1,375 % éch. 17/09/2024		1 000	1 034	0,35
3,500 % éch. 25/02/2033		800	850	0,29
Obligation internationale du gouvernement français				
0,500 % éch. 25/06/2044		850	524	0,18
Société Du Grand Paris EPIC				
0,300 % éch. 25/11/2031		1 900	1 545	0,53
1,000 % éch. 18/02/2070		100	44	0,02
Societe Nationale SNCF S.A.				
0,625 % éch. 17/04/2030		800	701	0,24
3,125 % éch. 02/11/2027		900	946	0,32
			5 644	1,93
Total France			18 419	6,29
ALLEMAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Amprion GmbH				
3,450 % éch. 22/09/2027		200	210	0,07
Commerzbank AG				
3,000 % éch. 14/09/2027		500	497	0,17
Deutsche Bahn Finance GmbH				
0,625 % éch. 08/12/2050		50	27	0,01
Deutsche Bank AG				
1,875 % éch. 23/02/2028		1 900	1 777	0,61
E.ON SE				
0,875 % éch. 18/10/2034		400	305	0,10
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				
0,000 % éch. 15/09/2028 (a)		100	90	0,03
1,375 % éch. 07/06/2032		15 600	14 290	4,88
2,000 % éch. 15/11/2029		10 400	10 377	3,55
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen				
1,000 % éch. 26/05/2042		700	525	0,18
Schaeffler AG				
3,375 % éch. 12/10/2028		1 700	1 585	0,54
Vonovia SE				
2,375 % éch. 25/03/2032		2 200	1 874	0,64
ZF Finance GmbH				
2,000 % éch. 06/05/2027		800	701	0,24
2,250 % éch. 03/05/2028		600	502	0,17
			32 760	11,19
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
République d'Allemagne				
0,000 % éch. 15/08/2031 (a)		1 400	1 207	0,41
État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie				
0,000 % éch. 12/10/2035 (a)		20	14	0,01
			1 221	0,42
Total Allemagne			33 981	11,61
INDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
JSW Hydro Energy Ltd.				
4,125 % éch. 18/05/2031	$	1 239	1 034	0,35
ReNew Power Pvt Ltd.				
5,875 % éch. 05/03/2027	$	1 400	$ 1 346	0,46
ReNew Wind Energy AP2				
4,500 % éch. 14/07/2028		1 700	1 429	0,49
Total Inde			3 809	1,30
IRLANDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AIB Group PLC				
2,875 % éch. 30/05/2031	€	600	576	0,20
Bank of Ireland Group PLC				
6,253 % éch. 16/09/2026	$	800	794	0,27
7,594 % éch. 06/12/2032	£	600	718	0,25
Smurfit Kappa Treasury ULC				
0,500 % éch. 22/09/2029	€	1 000	831	0,28
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.				
3,000 % éch. 19/04/2051	$	650	500	0,17
3,500 % éch. 02/05/2052		1 200	928	0,32
Total Irlande			4 347	1,49
ITALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Assicurazioni Generali SpA				
4,125 % éch. 04/05/2026	€	1 400	1 515	0,52
Ferrovie dello Stato Italiane SpA				
3,750 % éch. 14/04/2027		1 200	1 236	0,42
UniCredit SpA				
5,850 % éch. 15/11/2027		2 200	2 386	0,82
			5 137	1,76
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
1,500 % éch. 30/04/2045		1 050	627	0,21
Total Italie			5 764	1,97
JAPON				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
0,848 % éch. 19/07/2029		800	709	0,24
Mizuho Financial Group, Inc.				
3,490 % éch. 05/09/2027		1 300	1 352	0,46
Norinchukin Bank				
2,080 % éch. 22/09/2031	$	1 000	774	0,27
4,867 % éch. 14/09/2027		600	594	0,20
NTT Finance Corp.				
0,399 % éch. 13/12/2028	€	1 300	1 149	0,39
4,239 % éch. 25/07/2025	$	2 900	2 851	0,97
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
2,472 % éch. 14/01/2029		1 300	1 097	0,38
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
2,800 % éch. 10/03/2027		800	729	0,25
			9 255	3,16
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Japan Finance Organization for Municipalities				
0,010 % éch. 02/02/2028	€	400	359	0,13
Total Japon			9 614	3,29
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Aptiv PLC				
3,100 % éch. 01/12/2051	$	200	119	0,04
4,350 % éch. 15/03/2029		1 000	925	0,32
Total Jersey, Îles anglo-normandes			1 044	0,36
LUXEMBOURG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Acef Holding S.C.A.				
0,750 % éch. 14/06/2028	€	1 600	1 263	0,43
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund				
0,500 % éch. 27/01/2028		1 200	993	0,34
0,900 % éch. 12/10/2029		1 000	780	0,27

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CPI Property Group S.A.			
1,750 % éch. 14/01/2030	€ 600	$ 391	0,13
2,750 % éch. 22/01/2028	£ 900	725	0,25
Logicor Financing SARL			
2,000 % éch. 17/01/2034	€ 1 100	747	0,25
Prologis International Funding S.A.			
0,750 % éch. 23/03/2033	475	340	0,12
0,875 % éch. 09/07/2029	125	108	0,04
1,625 % éch. 17/06/2032	1 425	1 157	0,39
2,750 % éch. 22/02/2032	£ 200	193	0,07
3,625 % éch. 07/03/2030	€ 200	202	0,07
Segro Capital SARL			
0,500 % éch. 22/09/2031	1 000	757	0,26
SELP Finance SARL			
0,875 % éch. 27/05/2029	1 000	807	0,27
Total Luxembourg		8 463	2,89
ÎLE MAURICE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Greenko Solar Mauritius Ltd.			
5,950 % éch. 29/07/2026	$ 500	458	0,16
India Green Energy Holdings			
5,375 % éch. 29/04/2024	2 100	2 022	0,69
India Green Power Holdings			
4,000 % éch. 22/02/2027	400	343	0,12
Total Île Maurice		2 823	0,97
MEXIQUE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Nemak S.A.B. de C.V.			
2,250 % éch. 20/07/2028	€ 1 000	851	0,29
MULTINATIONAL			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC			
2,000 % éch. 01/09/2028	500	432	0,15
3,000 % éch. 01/09/2029	150	118	0,04
NXP BV			
2,500 % éch. 11/05/2031	$ 1 200	959	0,33
5,000 % éch. 15/01/2033	1 100	1 042	0,35
Total Multinational		2 551	0,87
PAYS-BAS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
ABN AMRO Bank NV			
2,470 % éch. 13/12/2029	3 400	2 755	0,94
Citycon Treasury BV			
1,625 % éch. 12/03/2028	€ 1 100	859	0,29
CTP NV			
1,250 % éch. 21/06/2029	2 300	1 636	0,56
Digital Intrepid Holding BV			
0,625 % éch. 15/07/2031	1 500	1 102	0,38
DSV Finance BV			
0,500 % éch. 03/03/2031	500	403	0,14
EnBW International Finance BV			
3,625 % éch. 22/11/2026	500	535	0,18
Enel Finance International NV			
0,000 % éch. 17/06/2027 (a)	600	543	0,19
0,875 % éch. 28/09/2034	1 300	934	0,32
1,375 % éch. 12/07/2026	$ 1 000	863	0,29
7,500 % éch. 14/10/2032	500	530	0,18
ING Groep NV			
1,125 % éch. 07/12/2028	£ 200	193	0,07
4,875 % éch. 16/05/2029 (c)(d)	$ 2 600	2 015	0,69
JDE Peet's NV			
2,250 % éch. 24/09/2031	1 000	758	0,26
LeasePlan Corp. NV			
0,250 % éch. 23/02/2026	€ 2 000	1 858	0,63
0,250 % éch. 07/09/2026	1 400	1 282	0,44
1,375 % éch. 07/03/2024	100	104	0,04
3,500 % éch. 09/04/2025	700	732	0,25
Lseg Netherlands BV			
0,250 % éch. 06/04/2028	400	360	0,12
Nationale-Nederlanden Bank NV			
0,500 % éch. 21/09/2028	€ 1 100	$ 953	0,33
1,875 % éch. 17/05/2032	200	190	0,06
NE Property BV			
2,000 % éch. 20/01/2030	1 400	1 037	0,35
TenneT Holding BV			
4,500 % éch. 28/10/2034	700	779	0,27
Thermo Fisher Scientific Finance BV			
0,000 % éch. 18/11/2025 (a)	1 400	1 355	0,46
Vesteda Finance BV			
0,750 % éch. 18/10/2031	1 200	933	0,32
VIA Outlets BV			
1,750 % éch. 15/11/2028	1 100	889	0,30
Wabtec Transportation Netherlands BV			
1,250 % éch. 03/12/2027	1 900	1 724	0,59
Total Pays-Bas		25 322	8,65
SINGAPOUR			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.			
4,250 % éch. 25/03/2027	$ 669	581	0,20
CORÉE DU SUD			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
SK Hynix, Inc.			
2,375 % éch. 19/01/2031	300	220	0,08
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Korea Water Resources Corp.			
3,500 % éch. 27/04/2025	700	676	0,23
Total Corée du Sud		896	0,31
ESPAGNE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Acciona Energia Financiacion Filiales S.A.			
1,375 % éch. 26/01/2032	€ 500	427	0,15
Banco Santander S.A.			
0,625 % éch. 24/06/2029	900	790	0,27
CaixaBank S.A.			
0,500 % éch. 09/02/2029	100	87	0,03
0,750 % éch. 26/05/2028	900	809	0,28
1,500 % éch. 03/12/2026	£ 600	631	0,21
3,750 % éch. 07/09/2029	€ 1 900	1 990	0,68
		4 734	1,62
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement espagnol			
1,000 % éch. 30/07/2042	1 700	1 104	0,38
Xunta de Galicia			
0,084 % éch. 30/07/2027	50	46	0,01
		1 150	0,39
Total Espagne		5 884	2,01
SUPRANATIONALES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial			
0,000 % éch. 28/07/2026 (a)	100	95	0,03
0,010 % éch. 23/06/2028	2 000	1 792	0,61
0,150 % éch. 10/10/2034	500	373	0,13
3,125 % éch. 09/11/2031	800	846	0,29
Banque européenne d'investissement			
0,750 % éch. 15/07/2027	AUD 500	289	0,10
1,500 % éch. 15/06/2032	€ 5 600	5 203	1,78
2,250 % éch. 15/03/2030	1 230	1 248	0,43
Union européenne			
0,000 % éch. 04/10/2030 (a)	1 400	1 186	0,40
0,300 % éch. 04/11/2050	100	51	0,02
0,400 % éch. 04/02/2037	800	579	0,20
2,625 % éch. 04/02/2048	200	193	0,07
2,750 % éch. 04/02/2033	300	308	0,10
Banque internationale pour la reconstruction et le développement			
2,125 % éch. 03/03/2025	$ 1 000	954	0,32
Association internationale de développement			
0,750 % éch. 21/09/2028	£ 1 450	$ 1 432	0,49
Total Supranational		14 549	4,97
SUÈDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Castellum AB			
0,750 % éch. 04/09/2026	€ 1 100	912	0,31
EQT AB			
0,875 % éch. 14/05/2031	1 200	890	0,30
Skandinaviska Enskilda Banken AB			
4,000 % éch. 09/11/2026	300	322	0,11
Volvo Car AB			
2,500 % éch. 07/10/2027	300	283	0,10
		2 407	0,82
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Svensk Exportkredit AB			
2,000 % éch. 30/06/2027	1 100	1 110	0,38
Total Suède		3 517	1,20
SUISSE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
UBS AG			
5,125 % éch. 15/05/2024 (d)	$ 900	890	0,30
ROYAUME-UNI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Assura Financing PLC			
1,625 % éch. 30/06/2033	£ 1 100	885	0,30
Atlantica Sustainable Infrastructure PLC			
4,125 % éch. 15/06/2028	$ 900	800	0,27
Berkeley Group PLC			
2,500 % éch. 11/08/2031	£ 1 300	1 050	0,36
British Land Co. PLC			
2,375 % éch. 14/09/2029	1 400	1 329	0,45
Burberry Group PLC			
1,125 % éch. 21/09/2025	600	643	0,22
Chanel Ceres PLC			
1,000 % éch. 31/07/2031	€ 2 200	1 814	0,62
Compass Group PLC			
4,375 % éch. 08/09/2032	£ 1 900	2 196	0,75
Derwent London PLC			
1,875 % éch. 17/11/2031	1 200	1 020	0,35
Grainger PLC			
3,375 % éch. 24/04/2028	700	697	0,24
Lendlease Europe Finance PLC			
3,500 % éch. 02/12/2033	800	619	0,21
London & Quadrant Housing Trust			
2,000 % éch. 31/03/2032	400	364	0,12
Marks & Spencer PLC			
3,750 % éch. 19/05/2026	800	841	0,29
4,500 % éch. 10/07/2027	300	311	0,11
NatWest Group PLC			
2,057 % éch. 09/11/2028	1 200	1 205	0,41
Santander UK Group Holdings PLC			
2,896 % éch. 15/03/2032	$ 2 400	1 860	0,64
Severn Trent Utilities Finance PLC			
2,625 % éch. 22/02/2033	£ 600	577	0,20
South Eastern Power Networks PLC			
1,750 % éch. 30/09/2034	2 100	1 764	0,60
Standard Chartered PLC			
0,800 % éch. 17/11/2029	€ 1 800	1 529	0,52
Travis Perkins PLC			
3,750 % éch. 17/02/2026	£ 1 100	1 175	0,40
Vodafone Group PLC			
5,125 % éch. 04/06/2081	$ 950	693	0,24
Workspace Group PLC			
2,250 % éch. 11/03/2028	£ 400	359	0,12
Zenith Finco PLC			
6,500 % éch. 30/06/2027	700	660	0,23
		22 391	7,65

Tableau des investissements Fonds PIMCO Climate Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Bon du Trésor britannique				
0,875 % éch. 31/07/2033	£	3 700	$ 3 323	1,14
Total Royaume-Uni			25 714	8,79
ÉTATS-UNIS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust				
2,100 % éch. 20/05/2048	$	1 062	758	0,26
4,000 % éch. 20/04/2049		1 049	856	0,29
4,950 % éch. 20/07/2049		1 952	1 811	0,62
Loanpal Solar Loan Ltd.				
2,220 % éch. 20/03/2048		611	448	0,15
			3 873	1,32
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AES Corp.				
1,375 % éch. 15/01/2026		1 300	1 156	0,40
Alexandria Real Estate Equities, Inc.				
2,000 % éch. 18/05/2032		400	307	0,11
3,000 % éch. 18/05/2051		400	255	0,09
Amgen, Inc.				
3,000 % éch. 22/02/2029		1 300	1 154	0,39
Autodesk, Inc.				
2,400 % éch. 15/12/2031		1 000	801	0,27
Avangrid, Inc.				
3,800 % éch. 01/06/2029		1 965	1 790	0,61
Bank of America Corp.				
2,456 % éch. 22/10/2025		100	94	0,03
6,204 % éch. 10/11/2028		500	517	0,18
Boston Properties LP				
2,450 % éch. 01/10/2033		1 400	1 011	0,35
CBRE Services, Inc.				
2,500 % éch. 01/04/2031		1 370	1 083	0,37
Community Preservation Corp.				
2,867 % éch. 01/02/2030		360	304	0,10
Continental Wind LLC				
6,000 % éch. 28/02/2033		559	561	0,19
Crown Cork & Seal Co., Inc.				
7,375 % éch. 15/12/2026		725	748	0,26
Dominion Energy, Inc.				
2,250 % éch. 15/08/2031		2 350	1 876	0,64
DTE Electric Co.				
1,900 % éch. 01/04/2028		2 200	1 916	0,65
Farmers Exchange Capital				
5,454 % éch. 15/10/2054		30	27	0,01
Ford Motor Co.				
3,250 % éch. 12/02/2032		200	150	0,05
6,100 % éch. 19/08/2032		834	772	0,26
Gap, Inc.				
3,625 % éch. 01/10/2029		1 250	883	0,30
3,875 % éch. 01/10/2031		500	349	0,12
Georgia Power Co.				
3,250 % éch. 15/03/2051		800	554	0,19
HAT Holdings LLC				
3,750 % éch. 15/09/2030	$	3 200	$ 2 357	0,81
6,000 % éch. 15/04/2025		500	485	0,17
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
4,000 % éch. 01/05/2031		500	419	0,14
Host Hotels & Resorts LP				
2,900 % éch. 15/12/2031		700	537	0,18
3,375 % éch. 15/12/2029		600	503	0,17
3,500 % éch. 15/09/2030		2 075	1 717	0,59
Hudson Pacific Properties LP				
3,950 % éch. 01/11/2027		1 000	852	0,29
5,950 % éch. 15/02/2028		800	748	0,26
Kilroy Realty LP				
2,500 % éch. 15/11/2032		2 000	1 425	0,49
2,650 % éch. 15/11/2033		300	209	0,07
Leeward Renewable Energy Operations LLC				
4,250 % éch. 01/07/2029		700	599	0,20
Liberty Utilities Finance GP				
2,050 % éch. 15/09/2030		2 475	1 865	0,64
MidAmerican Energy Co.				
2,700 % éch. 01/08/2052		950	613	0,21
4,250 % éch. 15/07/2049		400	341	0,12
Mississippi Power Co.				
3,100 % éch. 30/07/2051		900	577	0,20
Moody's Corp.				
2,000 % éch. 19/08/2031		300	238	0,08
3,100 % éch. 29/11/2061		840	533	0,18
New York State Electric & Gas Corp.				
2,150 % éch. 01/10/2031		1 100	860	0,29
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
1,900 % éch. 15/06/2028		2 100	1 797	0,61
Niagara Mohawk Power Corp.				
5,783 % éch. 16/09/2052		700	702	0,24
NiSource, Inc.				
5,000 % éch. 15/06/2052		300	274	0,09
Northern States Power Co.				
2,250 % éch. 01/04/2031		600	500	0,17
2,600 % éch. 01/06/2051		200	128	0,04
NSTAR Electric Co.				
3,100 % éch. 01/06/2051		1 070	741	0,25
4,950 % éch. 15/09/2052		300	292	0,10
Oberlin College				
2,874 % éch. 01/10/2051		1 800	1 075	0,37
PacifiCorp				
2,900 % éch. 15/06/2052		600	394	0,13
Public Service Co. of Colorado				
2,700 % éch. 15/01/2051		75	49	0,02
3,200 % éch. 01/03/2050		25	18	0,01
3,700 % éch. 15/06/2028		1 000	954	0,33
Public Service Co. of Oklahoma				
2,200 % éch. 15/08/2031		2 050	1 638	0,56
Solar Star Funding LLC				
5,375 % éch. 30/06/2035		157	153	0,05
Southern California Edison Co.				
2,500 % éch. 01/06/2031		1 800	1 488	0,51
Southwestern Public Service Co.				
3,150 % éch. 01/05/2050	$	450	$ 313	0,11
TerraForm Power Operating LLC				
5,000 % éch. 31/01/2028		1 650	1 488	0,51
Topaz Solar Farms LLC				
5,750 % éch. 30/09/2039		808	768	0,26
UDR, Inc.				
1,900 % éch. 15/03/2033		900	643	0,22
3,100 % éch. 01/11/2034		150	114	0,04
Verizon Communications, Inc.				
1,500 % éch. 18/09/2030		4 110	3 205	1,10
2,850 % éch. 03/09/2041		900	623	0,21
Wisconsin Electric Power Co.				
4,750 % éch. 30/09/2032		500	491	0,17
Wisconsin Public Service Corp.				
2,850 % éch. 01/12/2051		450	290	0,10
			49 324	16,86
OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX				
Obligations New York Water & Sewer System, New York Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				
5,724 % éch. 15/06/2042		170	183	0,06
Obligations New York Water & Sewer System, New York Revenue Bonds, Series 2010				
5,882 % éch. 15/06/2044		110	121	0,04
Obligations San Francisco, California public Utilities Commission Water Revenue Bonds, Series 2020				
1,988 % éch. 01/11/2031		255	203	0,07
2,825 % éch. 01/11/2041		145	108	0,04
Billets State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020				
2,154 % éch. 01/07/2030		170	139	0,05
			754	0,26
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Obligations du Trésor américain				
2,875 % éch. 15/05/2052		330	265	0,09
Billets du Trésor américain				
0,375 % éch. 30/11/2025		7 490	6 701	2,29
1,125 % éch. 15/01/2025		3 600	3 369	1,15
			10 335	3,53
Total États-Unis			64 286	21,97
ÎLES VIERGES BRITANNIQUES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.				
6,750 % éch. 24/04/2033		811	768	0,26
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BONS DU TRÉSOR AUTRICHIEN				
1,267 % éch. 23/02/2023 (a)(b)	€	2 700	2 877	0,98
Total instruments à court terme			2 877	0,98
Total des valeurs mobilières			**$ 248 281**	**84,84**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux directeur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Accords de mise en pension, à la valeur	Produits des accords de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
TDM	4,320 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 36 800	Obligations du Trésor américain 4,625 % échéance 15/02/2040	$ (38 412)	$ 36 800	$ 36 818	12,57
Total contrats de prise en pension						**$ (38 412)**	**$ 36 800**	**$ 36 818**	**12,57**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Longue	06/2023	107	$ (14)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	À découvert	03/2023	206	1 868	0,64
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	À découvert	03/2023	9	246	0,08
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	À découvert	03/2023	2	43	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Longue	03/2023	40	(1)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Longue	03/2023	455	(183)	(0,06)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Longue	03/2023	186	(112)	(0,04)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	À découvert	03/2023	38	(12)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	À découvert	03/2023	7	4	0,00
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	À découvert	03/2023	67	526	0,18
				$ 2 365	0,81
Total des instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé				**$ 2 365**	**0,81**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	2,000 %	15/03/2053	£ 900	$ 12	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027	$ 3 200	(174)	(0,06)
À payer	Billet CAD-Bank à 3 mois	1,000	16/06/2026	CAD 900	(51)	(0,02)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,840	08/07/2051	$ 500	156	0,05
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,943	15/06/2051	400	119	0,04
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028	€ 900	43	0,02
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053	2 000	72	0,03
					$ 177	0,06
Total des instruments financiers dérivés compensés					**$ 177**	**0,06**

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

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

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	02/2023	CAD 6 096	$ 4 592	$ 91	$ 0	$ 91	0,03
	02/2023	€ 5 037	5 287	0	(104)	(104)	(0,04)
	02/2023	£ 20 575	24 299	8	(486)	(478)	(0,16)
	02/2023	$ 2 189	€ 2 059	15	0	15	0,01
BPS	02/2023	€ 90 273	$ 93 607	0	(3 014)	(3 014)	(1,03)
	03/2023	MXN 7 361	365	0	(7)	(7)	0,00
BRC	01/2023	SGD 15	11	0	0	0	0,00
	02/2023	€ 1 580	1 637	0	(54)	(54)	(0,02)
	02/2023	$ 198	€ 186	1	0	1	0,00
CBK	02/2023	AUD 1 771	$ 1 186	0	(18)	(18)	(0,01)
	02/2023	£ 344	413	1	(3)	(2)	0,00
	02/2023	$ 1 601	€ 1 501	5	0	5	0,00
	02/2023	319	£ 262	0	(4)	(4)	0,00
DUB	02/2023	€ 29 732	$ 30 808	0	(1 016)	(1 016)	(0,35)
GLM	03/2023	$ 364	MXN 7 488	15	0	15	0,01
MYI	01/2023	€ 102	$ 109	0	0	0	0,00
	01/2023	£ 5	6	0	0	0	0,00
	01/2023	SGD 7	5	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 66	€ 61	0	0	0	0,00
	01/2023	251	£ 209	0	0	0	0,00
	02/2023	1 620	€ 1 555	44	0	44	0,02
RBC	02/2023	951	£ 789	0	0	0	0,00
SCX	02/2023	6 873	€ 6 487	70	0	70	0,02
UAG	02/2023	€ 753	$ 776	0	(30)	(30)	(0,01)
				$ 250	$ (4 736)	$ (4 486)	(1,53)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 366	CHF 346	$ 8	$ 0	$ 8	0,00
CBK	01/2023	640	604	14	0	14	0,01
				$ 22	$ 0	$ 22	0,01

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de Capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€ 18	$ 19	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BPS	01/2023	$ 83	€ 77	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	€ 121	$ 128	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 53 684	€ 51 778	1 600	0	1 600	0,55
JPM	01/2023	3 593	3 456	96	0	96	0,03
MBC	01/2023	€ 518	$ 551	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$ 65 553	€ 62 550	1 232	0	1 232	0,42
RYL	01/2023	€ 12 574	$ 13 313	0	(113)	(113)	(0,04)
SCX	01/2023	$ 61 271	€ 58 866	1 581	0	1 581	0,54
				$ 4 509	$ (116)	$ 4 393	1,50

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de Capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 4	$ 4	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$ 24 116	£ 19 978	0	(82)	(82)	(0,03)
BPS	01/2023	18	15	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	£ 188	$ 226	0	0	0	0,00
JPM	01/2023	$ 21 713	£ 17 981	0	(80)	(80)	(0,03)
MBC	01/2023	24 166	20 137	95	(34)	61	0,02
MYI	01/2023	£ 1	$ 1	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 66	£ 54	0	(1)	(1)	0,00
UAG	01/2023	£ 22	$ 27	1	0	1	0,00
	01/2023	$ 11	£ 9	0	0	0	0,00
				$ 96	$ (197)	$ (101)	(0,04)

Au 31 décembre 2022, la Catégorie d'actions de capitalisation couverte en SEK et la Catégorie d'actions de capitalisation administrative couverte en SEK avaient en cours les contrats de change à terme suivants :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	SEK 10	$ 1	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$ 196	SEK 2 015	0	(2)	(2)	0,00
BRC	01/2023	8 517	89 198	47	0	47	0,01
CBK	01/2023	SEK 32	$ 3	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 938	SEK 9 770	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	SEK 37	$ 4	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 9	SEK 90	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	SEK 14	$ 1	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 2 514	SEK 26 415	23	0	23	0,01
UAG	01/2023	SEK 8	$ 1	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 15 827	SEK 166 043	115	0	115	0,04
				$ 185	$ (2)	$ 183	0,06

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) de Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$ 3	SGD 4	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BOA	01/2023	1 292	1 773	30	0	30	0,01
GLM	01/2023	SGD 63	$ 46	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 1 461	SGD 1 996	28	0	28	0,01
MBC	01/2023	1 375	1 880	27	0	27	0,01
RYL	01/2023	SGD 3	$ 2	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	$ 3	SGD 5	0	0	0	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
UAG	01/2023	$ 25	SGD 34	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
				$ 85	$ (1)	$ 84	0,03
Total des instruments financiers dérivés hors cote						**$ 95**	**0,03**
Total des investissements						**$ 287 718**	**98,31**
Autres actifs et passifs à court terme						**$ 4 937**	**1,69**
Actif net						**$ 292 655**	**100,00**

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

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

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le coupon représente un rendement à échéance.

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

(d) Titre convertible conditionnel.

Un montant en numéraire de 3 781 $ (31 décembre 2021 : 2 349 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un titre d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 22 $) et un montant en numéraire de 4 260 $ (31 décembre 2021 : 0 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Mesures de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Titres cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 0	$ 248 281	$ 0	$ 248 281
Contrats de mise en pension	0	36 800	0	36 800
Instruments financiers dérivés[3]	2 683	(46)	0	2 637
Totaux	**$ 2 683**	**$ 285 035**	**$ 0**	**$ 287 718**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 0	$ 321 810	$ 0	$ 321 810
Instruments financiers dérivés[3]	836	3 725	0	4 561
Totaux	**$ 836**	**$ 325 535**	**$ 0**	**$ 326 371**

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

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

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

Garantie (reçue)/nantie d'instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ (522)	$ 560	$ 38	$ 16	$ 0	$ 16
BPS	(3 021)	2 670	(351)	305	(260)	45
BRC	(6)	40	34	637	(400)	237
CBK	1 594	(1 510)	84	(47)	0	(47)
DUB	(1 016)	990	(26)	S/O	S/O	S/O
GLM	42	(110)	(68)	(41)	0	(41)
HUS	S/O	S/O	S/O	988	(1 290)	(302)
JPM	16	0	16	13	0	13
MBC	1 318	(1 270)	48	S/O	S/O	S/O
MYI	43	(20)	23	(19)	22	3
RBC	0	0	0	699	(460)	239
RYL	(113)	0	(113)	S/O	S/O	S/O
SCX	1 674	(1 560)	114	994	(810)	184
UAG	86	0	86	(2)	(260)	(262)

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

Informations comparatives

Ce qui suit est une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières négociables admises à la cote sur une Bourse officielle	73,76	74,31
Valeurs mobilières négociables négociées sur un autre marché réglementé	11,04	23,74
Autres valeurs mobilières négociables	0,04	0,04
Contrats de mise en pension	12,57	S/O
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,81	0,29
Instruments financiers dérivés compensés	0,06	0,02
Instruments financiers dérivés hors cote	0,03	1,08

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Australie	0,31	1,49
Autriche	0,21	0,24
Belgique	0,40	0,62
Brésil	0,07	0,66
Canada	1,62	S/O
Chili	0,70	0,85
Chine	S/O	0,39
Chypre	0,28	S/O
Finlande	0,28	1,82
France	6,29	7,69
Allemagne	11,61	2,48
Hong Kong	S/O	0,41
Inde	1,30	0,97
Irlande	1,49	1,98
Italie	1,97	1,59
Japon	3,29	2,04
Jersey, Îles anglo-normandes	0,36	0,40
Luxembourg	2,89	2,99
Île Maurice	0,97	1,92
Mexique	0,29	0,34
Multinational	0,87	0,59
Pays-Bas	8,65	10,39
Singapour	0,20	0,53
Corée du Sud	0,31	0,21
Espagne	2,01	3,13
Supranational	4,97	2,59
Suède	1,20	0,79
Suisse	0,30	0,85
Royaume-Uni	8,79	9,61
États-Unis	21,97	33,05
Îles Vierges britanniques	0,26	0,28
Instruments à court terme	0,98	7,19
Contrats de mise en pension	12,57	S/O
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,81	0,29
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	S/O	0,00
Swaps de taux d'intérêt	0,06	0,02
Instruments financiers dérivés hors cote		
Contrats de change à terme	(1,53)	0,23
Contrats de change à terme couverts	1,56	0,85
Autres actifs et passifs courants	1,69	0,52
Actifs nets	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES NÉGOCIABLES				
AUSTRALIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement australien				
0,250 % éch. 21/11/2032	AUD	8 918	$ 3 128	0,23
0,750 % éch. 21/11/2027		6 370	2 684	0,19
3,000 % éch. 20/09/2025		2 202	1 193	0,09
Total Australie			7 005	0,51
CANADA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien				
0,500 % éch. 01/12/2050 (a)	CAD	237	146	0,01
4,250 % éch. 01/12/2026 (a)		2 801	2 281	0,17
Total Canada			2 427	0,18
ÎLES CAÏMANS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Allegro CLO Ltd.				
5,244 % éch. 16/10/2031	$	500	491	0,04
Anchorage Capital CLO Ltd.				
5,465 % éch. 22/07/2032		2 200	2 153	0,16
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				
5,169 % éch. 15/01/2031		6 458	6 335	0,46
5,229 % éch. 16/01/2030		1 190	1 178	0,09
Barings CLO Ltd.				
5,043 % éch. 20/01/2028		1 712	1 704	0,12
BlueMountain CLO Ltd.				
5,505 % éch. 22/10/2030		1 912	1 885	0,14
Carbone CLO Ltd.				
5,383 % éch. 20/01/2031		4 700	4 636	0,34
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.				
5,079 % éch. 15/01/2031		591	585	0,04
Catamaran CLO Ltd.				
5,425 % éch. 22/04/2030		2 786	2 746	0,20
Cedar Funding CLO Ltd.				
5,179 % éch. 17/07/2031		700	688	0,05
CIFC Funding Ltd.				
5,194 % éch. 18/04/2031		2 600	2 554	0,19
5,418 % éch. 27/04/2031		1 200	1 185	0,09
Dryden CLO Ltd.				
5,616 % éch. 15/05/2031		700	690	0,05
Elevation CLO Ltd.				
5,355 % éch. 15/10/2029		1 975	1 963	0,14
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				
5,498 % éch. 15/09/2037		2 509	2 471	0,18
ICG U.S. CLO Ltd.				
5,405 % éch. 22/07/2031		2 500	2 447	0,18
LCM LP				
5,209 % éch. 15/10/2031		1 200	1 175	0,09
5,283 % éch. 20/07/2031		3 300	3 252	0,24
Madison Park Funding Ltd.				
0,000 % éch. 29/07/2030		400	394	0,03
4,829 % éch. 15/04/2029		4 498	4 451	0,32
5,155 % éch. 22/04/2027		418	414	0,03
Magnetite Ltd.				
5,059 % éch. 15/04/2031		297	292	0,02
Marathon CLO Ltd.				
5,545 % éch. 21/11/2027		40	40	0,00
Octagon Investment Partners Ltd.				
5,039 % éch. 16/04/2031		3 500	3 452	0,25
Octagon Loan Funding Ltd.				
5,854 % éch. 18/11/2031		2 500	2 466	0,18
OZLM Ltd.				
5,159 % éch. 17/04/2031		2 759	2 698	0,20
5,393 % éch. 20/01/2031		3 400	3 345	0,24
Regatta Funding Ltd.				
5,329 % éch. 17/10/2030		4 300	4 253	0,31
Sound Point CLO Ltd.				
5,344 % éch. 18/04/2031		2 200	2 153	0,16
5,363 % éch. 21/01/2031		1 400	1 367	0,10
5,427 % éch. 26/07/2031		1 500	1 460	0,11
TIAA CLO Ltd.				
5,443 % éch. 20/07/2031		500	492	0,04
TICP CLO Ltd.				
5,083 % éch. 20/04/2028	$	561	$ 559	0,04
Venture CLO Ltd.				
4,959 % éch. 15/07/2027		26	27	0,00
Voya CLO Ltd.				
5,111 % éch. 14/07/2031		495	488	0,03
5,289 % éch. 15/10/2030		1 992	1 970	0,14
			68 459	5,00
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % éch. 18/11/2027		258	207	0,01
Total Îles Caïmans			68 666	5,01
DANEMARK				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Jyske Realkredit A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	30 616	3 238	0,24
1,000 % éch. 01/10/2053		6 320	623	0,05
1,500 % éch. 01/10/2053		14 417	1 541	0,11
2,000 % éch. 01/10/2053		2 785	318	0,02
2,500 % éch. 01/10/2047		1	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
0,500 % éch. 01/10/2043		6 846	751	0,05
1,000 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		3 900	401	0,03
2,000 % éch. 01/10/2053		1 000	114	0,01
2,500 % éch. 01/10/2047		3	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050		145 960	15 440	1,13
1,000 % éch. 01/10/2053		6 879	721	0,05
1,500 % éch. 01/10/2053		129 152	13 569	0,99
2,000 % éch. 01/10/2053		6 082	674	0,05
2,500 % éch. 01/10/2047		13	2	0,00
3,500 % éch. 01/10/2053		22 504	2 969	0,22
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050		55 013	5 824	0,43
1,000 % éch. 01/10/2053		5 286	530	0,04
1,500 % éch. 01/10/2053		17 923	1 942	0,14
2,000 % éch. 01/10/2053		3 924	430	0,03
2,500 % éch. 01/04/2047		13	2	0,00
			49 089	3,59
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement danois				
0,100 % éch. 15/11/2023 (a)		13 467	1 941	0,14
Total Danemark			51 030	3,73
FRANCE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement français				
0,100 % éch. 01/03/2025 (a)	€	19 368	20 850	1,52
0,100 % éch. 25/07/2031 (a)		9 547	9 756	0,71
0,100 % éch. 25/07/2038 (a)		6 889	6 591	0,48
2,100 % éch. 25/07/2023 (a)		33 178	36 276	2,65
Total France			73 473	5,36
ALLEMAGNE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
République d'Allemagne				
0,100 % éch. 15/04/2023 (a)		13 849	14 662	1,07
IRLANDE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Ares European CLO				
2,038 % éch. 15/10/2030		1 396	1 454	0,11
Ares European CLO DAC				
1,988 % éch. 15/04/2030		692	718	0,05
2,158 % éch. 15/10/2031		4 000	4 138	0,30
2,306 % éch. 20/04/2032		2 100	2 177	0,16
Armada Euro CLO DAC				
2,098 % éch. 15/07/2031		500	518	0,04
Bain Capital Euro CLO DAC				
2,602 % éch. 24/01/2033		1 300	1 356	0,10
Black Diamond CLO DAC				
2,316 % éch. 20/01/2032	€	2 266	$ 2 365	0,17
2,778 % éch. 15/05/2032		2 600	2 690	0,20
2,834 % éch. 03/10/2029		11	11	0,00
4,793 % éch. 03/10/2029	$	7	7	0,00
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				
1,050 % éch. 15/01/2031	€	1 000	960	0,07
2,098 % éch. 15/01/2031		2 099	2 179	0,16
BNPP AM Euro CLO DAC				
1,978 % éch. 15/04/2031		1 600	1 655	0,12
Cairn CLO BV				
2,158 % éch. 15/10/2031		2 300	2 403	0,18
Cairn CLO DAC				
2,688 % éch. 20/10/2028		48	51	0,00
Carlyle Euro CLO DAC				
2,078 % éch. 15/01/2031		2 199	2 290	0,17
2,688 % éch. 15/08/2032		900	933	0,07
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
2,548 % éch. 15/11/2031		3 850	3 982	0,29
CVC Cordatus Loan Fund DAC				
2,788 % éch. 26/08/2032		500	516	0,04
Dryden Euro CLO DAC				
2,512 % éch. 15/05/2032		1 332	1 382	0,10
2,622 % éch. 15/05/2034		2 400	2 489	0,18
Harvest CLO DAC				
1,040 % éch. 15/07/2031		700	675	0,05
2,138 % éch. 15/07/2031		1 400	1 443	0,10
2,433 % éch. 18/11/2029		239	252	0,02
2,775 % éch. 26/06/2030		1 544	1 611	0,12
Invesco Euro CLO DAC				
2,298 % éch. 15/07/2032		2 600	2 695	0,20
Jubilee CLO DAC				
2,846 % éch. 15/12/2029		1 651	1 729	0,13
Laurelin DAC				
2,176 % éch. 20/10/2031		1 200	1 242	0,09
Madison Park Euro Funding DAC				
2,178 % éch. 15/07/2032		700	724	0,05
Man GLG Euro CLO DAC				
2,248 % éch. 15/01/2030		143	149	0,01
Oak Hill European Credit Partners DAC				
2,196 % éch. 20/10/2031		1 100	1 139	0,08
OCP Euro CLO DAC				
2,382 % éch. 22/09/2034		2 600	2 697	0,20
Palmer Square European Loan Funding DAC				
2,098 % éch. 15/10/2031		880	911	0,07
Rockford Tower Europe CLO DAC				
3,077 % éch. 20/12/2031		2 700	2 808	0,20
Segovia European CLO DAC				
2,336 % éch. 20/07/2032		2 300	2 377	0,17
Tikehau CLO DAC				
2,596 % éch. 04/08/2034		2 600	2 694	0,20
Toro European CLO DAC				
2,298 % éch. 15/07/2030		844	885	0,06
2,572 % éch. 15/02/2034		3 700	3 809	0,28
			62 114	4,54
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES				
European Loan Conduit DAC				
2,803 % éch. 17/02/2030		587	599	0,04
Total Irlande			62 713	4,58
ITALIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
0,400 % éch. 15/05/2030 (a)		18 193	17 000	1,24
0,450 % éch. 22/05/2023 (a)		3 613	3 835	0,28
1,400 % éch. 26/05/2025 (a)		30 238	31 860	2,33
2,350 % éch. 15/09/2024 (a)		25 854	28 436	2,08
2,550 % éch. 15/09/2041 (a)		1 440	1 561	0,11
2,600 % éch. 15/09/2023 (a)		11 694	12 733	0,93
Total Italie			95 425	6,97

Tableau des investissements Fonds Commodity Real Return Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
JAPON				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement japonais				
0,005 % éch. 10/03/2031 (a)	¥	344 434	$ 2 706	0,20
0,100 % éch. 10/09/2024 (a)		926 640	7 198	0,52
0,100 % éch. 10/03/2025 (a)		1 007 525	7 827	0,57
0,100 % éch. 10/03/2026 (a)		763 284	5 990	0,44
0,100 % éch. 10/03/2028 (a)		1 320 329	10 352	0,76
0,100 % éch. 10/03/2029 (a)		4 185 494	32 927	2,40
Total Japon			67 000	4,89
PAYS-BAS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Syngenta Finance NV				
4,441 % éch. 24/04/2023	$	400	398	0,03
NOUVELLE-ZÉLANDE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais				
2,000 % éch. 20/09/2025	NZD	4 748	1 920	0,14
PÉROU				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement péruvien				
5,940 % éch. 12/02/2029	PEN	2 200	530	0,04
QATAR				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement qatari				
3,875 % éch. 23/04/2023	$	300	299	0,02
ARABIE SAOUDITE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie Saoudite				
4,000 % éch. 17/04/2025		310	306	0,02
ESPAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
5,875 % éch. 24/09/2023 (b)(d)	€	400	411	0,03
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement espagnol				
0,150 % éch. 30/11/2023 (a)		16 449	17 694	1,29
0,500 % éch. 30/04/2030		2 500	2 186	0,16
0,650 % éch. 30/11/2027 (a)		26 422	27 874	2,04
0,700 % éch. 30/11/2033 (a)		1 302	1 299	0,09
			49 053	3,58
Total Espagne			49 464	3,61
SUÈDE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement suédois				
0,125 % éch. 01/06/2026	SEK	2 937	285	0,02
0,125 % éch. 01/12/2027		15 332	1 477	0,11
1,000 % éch. 01/06/2025		119 286	11 842	0,86
Total Suède			13 604	0,99
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
NatWest Group PLC				
4,519 % éch. 25/06/2024	$	400	397	0,03
6,274 % éch. 25/06/2024		600	600	0,04
			997	0,07

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES				
Great Hall Mortgages PLC				
3,675 % éch. 18/03/2039	£	9	$ 11	0,00
3,695 % éch. 18/06/2038		9	11	0,00
Polaris PLC				
4,232 % éch. 23/10/2059		3 541	4 165	0,30
Towd Point Mortgage Funding PLC				
4,071 % éch. 20/10/2051		1 007	1 204	0,09
			5 391	0,39
		ACTIONS		
TITRES DE PRÉFÉRENCE				
Nationwide Building Society				
10,250 %		7 021	1 058	0,08
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Bon du Trésor britannique				
0,125 % éch. 22/03/2024 (a)	£	16 752	20 486	1,49
0,125 % éch. 22/03/2026 (a)		12 819	15 566	1,14
0,125 % éch. 10/08/2028 (a)		4 270	5 150	0,38
0,125 % éch. 10/08/2041 (a)		4 321	4 899	0,36
1,250 % éch. 22/11/2027 (a)		30 812	39 234	2,86
2,500 % éch. 17/07/2024		22 090	29 004	2,12
			114 339	8,35
Total Royaume-Uni			121 785	8,89
ÉTATS-UNIS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
5,439 % éch. 25/12/2033	$	854	820	0,06
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,349 % éch. 25/10/2035		1 300	1 169	0,09
Asset-Backed Funding Certificates Trust				
4,529 % éch. 25/10/2036		2 426	2 199	0,16
4,989 % éch. 25/10/2034		203	203	0,01
CIT Mortgage Loan Trust				
5,739 % éch. 25/10/2037		110	110	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust				
4,679 % éch. 25/09/2036		509	484	0,04
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,334 % éch. 25/10/2034		324	312	0,02
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
5,079 % éch. 25/10/2035 ^		800	722	0,05
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
5,349 % éch. 25/02/2036		2 025	1 973	0,14
Ellington Loan Acquisition Trust				
5,489 % éch. 25/05/2037		649	624	0,05
First Franklin Mortgage Loan Trust				
4,699 % éch. 25/07/2036		158	148	0,01
5,664 % éch. 25/07/2034		1 750	1 695	0,12
Home Equity Asset Trust				
5,244 % éch. 25/08/2034		108	105	0,01
5,409 % éch. 25/03/2035		1 465	1 374	0,10
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
4,529 % éch. 25/11/2036		702	627	0,05
Lehman XS Trust				
6,689 % éch. 25/12/2037		855	840	0,06
Mid-State Capital Corp. Trust				
5,787 % éch. 15/10/2040		86	84	0,01
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,049 % éch. 25/01/2035		375	361	0,03
5,364 % éch. 25/07/2034		143	136	0,01
New Century Home Equity Loan Trust				
5,154 % éch. 25/02/2035		493	471	0,03
Option One Mortgage Loan Trust				
4,929 % éch. 25/01/2036		1 700	1 506	0,11
Renaissance Home Equity Loan Trust				
5,589 % éch. 25/11/2034		187	162	0,01
Residential Asset Securities Corp. Trust				
5,274 % éch. 25/08/2035		6	6	0,00
Saxon Asset Securities Trust				
4,679 % éch. 25/09/2036		3 000	2 742	0,20
4,699 % éch. 25/09/2037		262	247	0,02

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
5,109 % éch. 25/10/2035	$	1 495	$ 1 302	0,09
5,364 % éch. 25/08/2034		2 054	1 975	0,14
			22 397	1,63
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Broadcom, Inc.				
3,137 % éch. 15/11/2035		1 459	1 077	0,08
Lehman Brothers Holdings, Inc.				
7,875 % éch. 08/05/2018 ^	£	100	1	0,00
			1 078	0,08
OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX				
Obligations American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010				
7,734 % éch. 15/02/2033	$	200	228	0,02
Obligations Bay Area Toll Authority, California Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				
6,918 % éch. 01/04/2040		600	702	0,05
Obligations California State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2009				
7,300 % éch. 01/10/2039		500	608	0,04
7,500 % éch. 01/04/2034		100	121	0,01
7,550 % éch. 01/04/2039		200	251	0,02
Obligations Los Angeles Department of Water & Power, California Revenue Bonds, Series 2010				
5,516 % éch. 01/07/2027		500	512	0,04
Obligations New York York Transitional Finance Authority Future Tax Secured , New York Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				
5,508 % éch. 01/08/2037		200	206	0,01
Obligations New York State Urban Development Corp. Revenue Bonds, (BABs), Series 2009				
5,770 % éch. 15/03/2039		100	103	0,01
			2 731	0,20
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES				
Banc of America Funding Trust				
4,496 % éch. 20/09/2034		7	7	0,00
BCAP LLC Trust				
5,250 % éch. 26/04/2037		195	117	0,01
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,255 % éch. 25/05/2047 ^		6	5	0,00
3,575 % éch. 25/09/2034		55	51	0,00
3,810 % éch. 25/01/2035		22	20	0,00
4,089 % éch. 25/02/2034		7	6	0,00
4,111 % éch. 25/11/2034		5	4	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,044 % éch. 25/10/2033		9	8	0,00
3,697 % éch. 25/08/2036 ^		13	7	0,00
Chase Mortgage Finance Trust				
3,393 % éch. 25/03/2037 ^		5	4	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
3,440 % éch. 25/09/2035		1	1	0,00
5,500 % éch. 25/08/2034		382	352	0,03
Countrywide Alternative Loan Trust				
3,435 % éch. 25/02/2037 ^		6	5	0,00
4,563 % éch. 20/07/2046 ^		9	7	0,00
4,769 % éch. 25/09/2046 ^		8	8	0,00
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
3,632 % éch. 25/09/2047 ^		6	5	0,00
5,029 % éch. 25/03/2035		66	59	0,01
5,149 % éch. 25/09/2034		1	1	0,00
Greenpoint Mortgage Funding Trust				
4,829 % éch. 25/06/2045		72	66	0,01
GSR Mortgage Loan Trust				
3,154 % éch. 25/06/2034		4	4	0,00
3,652 % éch. 25/07/2035		39	36	0,00
3,767 % éch. 25/09/2035		2	2	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust				
5,253 % éch. 20/06/2035		197	173	0,01
Impac CMB Trust				
5,289 % éch. 25/10/2033		1	1	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust				
4,869 % éch. 25/07/2035		1 352	1 247	0,09
5,029 % éch. 25/07/2045		3	2	0,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
JPMorgan Mortgage Trust			
3,527 % éch. 25/04/2035	$ 20	$ 19	0,00
4,236 % éch. 25/08/2035	6	6	0,00
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust			
4,758 % éch. 15/12/2030	1	1	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
5,079 % éch. 25/08/2036	3 500	3 286	0,24
New Residential Mortgage Loan Trust			
4,500 % éch. 25/05/2058	468	440	0,03
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
6,189 % éch. 25/04/2035	500	472	0,04
Regal Trust			
2,605 % éch. 29/09/2031	7	6	0,00
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust			
6,500 % éch. 25/03/2032	6	6	0,00
Sequoia Mortgage Trust			
4,272 % éch. 20/04/2035	19	18	0,00
4,753 % éch. 20/07/2036	583	499	0,04
5,039 % éch. 19/10/2026	3	3	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust			
4,919 % éch. 19/07/2034	2	2	0,00
4,999 % éch. 19/10/2034	8	7	0,00
5,039 % éch. 19/03/2034	7	7	0,00
Towd Point Mortgage Trust			
2,750 % éch. 25/10/2056	453	446	0,03
3,250 % éch. 25/03/2058	611	586	0,04
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
3,448 % éch. 25/06/2042	1	1	0,00
5,009 % éch. 25/01/2045	11	10	0,00
5,129 % éch. 25/01/2045	56	54	0,01
5,169 % éch. 25/10/2044	165	149	0,01
		8 216	0,60
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Fannie Mae			
4,959 % éch. 25/09/2036	1	1	0,00
5,188 % éch. 01/11/2034	163	162	0,01
6,000 % éch. 25/02/2044	4	4	0,00
6,500 % éch. 25/06/2028	5	5	0,00
Freddie Mac			
3,848 % éch. 01/01/2034	$ 1	$ 1	0,00
4,473 % éch. 15/03/2024	1	1	0,00
4,669 % éch. 25/09/2031	8	8	0,00
4,768 % éch. 15/12/2031	1	1	0,00
4,818 % éch. 15/04/2028	4	4	0,00
4,968 % éch. 15/03/2032	51	51	0,00
5,000 % éch. 15/01/2035	186	186	0,01
6,000 % éch. 15/04/2036	3	3	0,00
Ginnie Mae			
2,673 % éch. 20/10/2043	438	418	0,03
3,858 % éch. 20/08/2068	539	524	0,04
3,868 % éch. 20/08/2062	896	890	0,07
4,603 % éch. 20/02/2035	26	26	0,00
4,605 % éch. 20/03/2060	21	20	0,00
4,843 % éch. 20/02/2038	14	14	0,00
4,911 % éch. 20/07/2062	560	558	0,04
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,500 % éch. 01/01/2053	900	762	0,06
3,000 % éch. 01/02/2053	20 500	18 012	1,32
4,000 % éch. 01/03/2053	62 714	58 853	4,30
4,500 % éch. 01/02/2053	4 700	4 525	0,33
		85 029	6,21
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (a)			
0,125 % éch. 15/07/2024	37 396	36 195	2,64
0,125 % éch. 15/10/2024 (e)	125 546	120 922	8,83
0,125 % éch. 15/04/2025	58 372	55 640	4,06
0,125 % éch. 15/10/2025	50 529	48 033	3,51
0,125 % éch. 15/04/2026 (e)	69 684	65 533	4,78
0,125 % éch. 15/07/2026	6 849	6 456	0,47
0,125 % éch. 15/10/2026 (e)	196 281	184 045	13,44
0,125 % éch. 15/07/2031	1 134	1 003	0,07
0,125 % éch. 15/02/2051	572	369	0,03
0,250 % éch. 15/01/2025 (e)	64 161	61 556	4,49
0,250 % éch. 15/07/2029	1 875	1 718	0,13
0,250 % éch. 15/02/2050	695	470	0,03
0,375 % éch. 15/07/2023	33 675	33 277	2,43
0,375 % éch. 15/07/2025	19 581	18 810	1,37
0,375 % éch. 15/01/2027	3 836	3 619	0,26
0,375 % éch. 15/07/2027	6 432	6 064	0,44
0,500 % éch. 15/04/2024 (e)	68 442	66 564	4,86
0,500 % éch. 15/01/2028	$ 52 790	$ 49 664	3,63
0,625 % éch. 15/04/2023	13 951	13 809	1,01
0,625 % éch. 15/01/2024 (e)	109 059	106 753	7,79
0,625 % éch. 15/01/2026	20 466	19 651	1,43
0,750 % éch. 15/07/2028	39 328	37 481	2,74
0,750 % éch. 15/02/2045	759	615	0,05
0,875 % éch. 15/02/2047	3 703	3 040	0,22
1,000 % éch. 15/02/2046	1 509	1 283	0,09
1,375 % éch. 15/02/2044	2 941	2 734	0,20
1,625 % éch. 15/10/2027	26 857	26 838	1,96
1,750 % éch. 15/01/2028	5 758	5 756	0,42
2,125 % éch. 15/02/2040	524	555	0,04
2,125 % éch. 15/02/2041	952	1 010	0,07
2,375 % éch. 15/01/2025	16 914	16 931	1,24
2,500 % éch. 15/01/2029	1 678	1 750	0,13
3,875 % éch. 15/04/2029	1 180	1 327	0,10
		999 471	72,96
Total États-Unis		1 118 922	81,68
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BILLETS DE TRÉSORERIE			
AT&T, Inc.			
4,650 % éch. 03/01/2023	440	440	0,03
Crown Castle International Corp.			
5,100 % éch. 05/01/2023	340	340	0,02
Enel Finance America LLC			
6,000 % échéance 12/01/2023	510	509	0,04
Total instruments à court terme		1 289	0,09
Total des valeurs mobilières		**$ 1 750 918**	**127,81**

	ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)	12 099	120	0,01
Total Fonds d'investissement		**$120**	**0,01**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux directeur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Accords de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
FICC	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 613	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 29/06/2023	$ (625)	$ 613	$ 613	0,04
IND	4,290	30/12/2022	03/01/2023	58 500	Billet du Trésor américain 4,750 % échéance 15/02/2041	(60 504)	58 500	58 528	4,28
Total des contrats de mise en pension						**$ (61 129)**	**$ 59 113**	**$ 59 141**	**4,32**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois mars	Longue	03/2023	487	$ (4 265)	(0,31)
Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans mars	À découvert	03/2023	69	63	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars	À découvert	03/2023	63	279	0,02
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	À découvert	01/2023	13	10	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Longue	03/2023	356	(915)	(0,07)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	À découvert	03/2023	577	2 933	0,21
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	À découvert	03/2023	513	4 620	0,34
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	À découvert	03/2023	196	4 464	0,33
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars	À découvert	03/2023	15	142	0,01
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars	À découvert	03/2023	920	744	0,05
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	À découvert	03/2023	64	1 298	0,09
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	À découvert	01/2023	13	(67)	0,00

Tableau des investissements Fonds Commodity Real Return Fund (suite)

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Longue	03/2023	131	$ 25	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Longue	03/2023	74	(66)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Longue	03/2023	704	(899)	(0,07)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	À découvert	03/2023	512	348	0,03
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Longue	03/2023	10	(14)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	À découvert	03/2023	547	491	0,04
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Longue	03/2023	47	(369)	(0,03)
				$ 8 822	0,64
Total des instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé				**$ 8 822**	**0,64**

(1) Option de style contrat à terme standardisé.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

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

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant du notionnel(2)	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
General Electric Co.	1,000 %	20/12/2023	$ 200	$ 14	0,00

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	0,500 %	16/03/2042	£ 7 200	$ 89	0,01
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,300	20/09/2027	¥ 74 880	10	0,00
À recevoir	Indice USD-Federal Funds Rate composé-OIS à 1 jour	2,000	15/12/2047	$ 1 750	383	0,03
À recevoir	Indice USD-Federal Funds Rate composé-OIS à 1 jour	2,428	20/12/2047	400	59	0,00
À recevoir	Indice USD-Federal Funds Rate composé-OIS à 1 jour	2,478	20/12/2047	1 115	152	0,01
À recevoir	Indice USD-Federal Funds Rate composé-OIS à 1 jour	2,499	20/12/2047	570	77	0,01
À payer	EURIBOR EUR à 3 mois	0,526	21/11/2023	€ 9 900	(361)	(0,03)
À recevoir	NZD-BBR à 3 mois	3,250	21/03/2028	NZD 900	34	0,00
À recevoir(3)	LIBOR USD à 3 mois	1,840	21/11/2028	$ 13 800	1 135	0,08
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,880	25/01/2052	5 000	(1 452)	(0,11)
À payer(3)	LIBOR USD à 3 mois	1,888	21/11/2053	2 800	(767)	(0,06)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,000	04/11/2032	€ 5 600	(1 568)	(0,11)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,000	08/11/2032	4 900	(1 322)	(0,10)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,190	04/11/2052	900	400	0,03
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,195	04/11/2052	950	479	0,04
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,197	08/11/2052	1 600	708	0,05
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	200	(9)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027	4 900	(502)	(0,04)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	11/05/2027	2 400	(245)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027	2 100	(211)	(0,02)
À recevoir(3)	EURIBOR EUR à 6 mois	0,830	09/12/2052	7 000	208	0,02
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	4 700	(416)	(0,03)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	2 100	(186)	(0,01)
À payer(3)	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	68 200	(2 064)	(0,15)
À payer	CPTFEMU	1,066	15/02/2024	3 800	(573)	(0,04)
À payer	CPTFEMU	1,168	15/03/2024	3 300	(494)	(0,04)
À payer	CPTFEMU	1,380	15/03/2031	4 000	(819)	(0,06)
À payer	CPTFEMU	1,475	15/05/2023	1 900	(227)	(0,02)
À payer	CPTFEMU	1,535	15/06/2023	2 900	(333)	(0,02)
À payer	CPTFEMU	1,946	15/03/2048	60	(16)	0,00
À payer	CPTFEMU	2,421	15/05/2052	700	(82)	(0,01)
À recevoir	CPTFEMU	2,470	15/07/2032	11 900	260	0,02
À payer	CPTFEMU	2,488	15/05/2037	4 790	(285)	(0,02)
À recevoir	CPTFEMU	2,570	15/06/2032	8 800	254	0,02
À payer	CPTFEMU	2,580	15/03/2052	500	(42)	0,00
À payer	CPTFEMU	2,590	15/03/2052	4 940	(362)	(0,03)
À recevoir	CPTFEMU	2,600	15/05/2032	10 600	383	0,03
À payer	CPTFEMU	3,520	15/09/2024	13 600	(228)	(0,02)
À payer	CPTFEMU	3,720	15/09/2024	5 000	(55)	0,00
À payer	CPTFEMU	3,850	15/09/2024	19 500	(203)	(0,01)
À recevoir	CPTFEMU	4,375	15/06/2024	100 000	1 442	0,11
À recevoir	CPURNSA	1,798	25/08/2027	$ 1 000	143	0,01
À recevoir	CPURNSA	1,890	27/08/2027	3 000	410	0,03
À payer	CPURNSA	1,954	03/06/2029	700	(91)	(0,01)
À payer	CPURNSA	1,998	25/07/2029	3 600	(448)	(0,03)
À payer	CPURNSA	2,155	17/10/2027	1 900	(214)	(0,02)
À recevoir	CPURNSA	2,210	05/02/2023	5 270	476	0,04
À recevoir	CPURNSA	2,263	27/04/2023	1 450	121	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,263	09/05/2023	1 790	149	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,311	24/02/2031	5 100	531	0,04
À payer	CPURNSA	2,335	05/02/2028	2 680	(244)	(0,02)
À payer	CPURNSA	2,353	09/05/2028	1 790	(153)	(0,01)

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	CPURNSA	2,360 %	09/05/2028	$ 2 690	$ (228)	(0,02)
À payer	CPURNSA	2,364	10/05/2028	2 750	(232)	(0,02)
À recevoir	CPURNSA	2,419	05/03/2026	2 300	210	0,02
À recevoir	CPURNSA	2,573	26/08/2028	1 100	66	0,00
À recevoir	CPURNSA	2,645	10/09/2028	1 500	79	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,690	01/06/2026	2 100	154	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,703	25/05/2026	1 270	93	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,768	13/05/2026	3 100	220	0,02
À recevoir	CPURNSA	2,813	14/05/2026	1 400	96	0,01
À recevoir	FRCPXTOB	1,030	15/03/2024	€ 3 300	323	0,02
À payer	FRCPXTOB	1,910	15/01/2038	390	(83)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,100	15/06/2031	£ 2 300	(392)	(0,03)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,400	15/06/2030	1 610	(344)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,515	15/02/2041	2 700	(336)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,530	15/10/2031	540	(121)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,566	15/03/2036	2 700	(428)	(0,03)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,580	15/03/2036	2 000	(393)	(0,03)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,066	15/09/2031	300	(41)	0,00
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,125	15/09/2032	590	7	0,00
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,130	15/09/2032	2 610	30	0,00
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,143	15/10/2032	2 300	24	0,00
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,480	15/09/2023	1 500	236	0,02
À recevoir	IPC Royaume-Uni	5,200	15/06/2024	1 200	61	0,00
À recevoir	IPC Royaume-Uni	5,330	15/06/2024	14 700	700	0,05
À payer	IPC Royaume-Uni	6,500	15/03/2024	3 400	(237)	(0,02)
À recevoir	IPC Royaume-Uni	6,600	15/05/2024	12 400	645	0,05
					$ (5 960)	(0,43)
Total des instruments financiers dérivés compensés					**$ (5 946)**	**(0,43)**

(1) Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(2) Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, tel que défini par les termes de ce contrat de swap précis.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Voir note 2, Transactions sur titres et revenus sur investissements, dans les Notes relatives aux États financiers pour plus d'informations.

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

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

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,000 %	15/03/2023	600	$ 68	$ 325	0,02
BRC	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 2 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,410	02/02/2023	30 200	151	0	0,00
CBK	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 2 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,720	23/02/2023	58 700	323	0	0,00
DUB	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,237	17/11/2023	10 300	639	2 291	0,17
GLM	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,200	26/04/2023	21 100	225	13	0,00
JPM	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 2 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,710	25/01/2023	62 600	382	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,000	15/03/2023	600	66	325	0,02
MYC	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 2 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,428	31/01/2023	30 000	153	0	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,200	31/05/2023	59 700	716	71	0,01
							$ 2 723	$ 3 025	0,22

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente – Indice hors cote iTraxx Europe 37 à 5 ans	Vente	3,000 %	15/03/2023	1 800	$ (3)	$ 0	0,00

OPTIONS PLAFONNÉES SUR L'INFLATION

Contrepartie	Description	Indice initial	Taux variable	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	Taux plafond - CPALEMU hors cote	$ 100,151	Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 3,000 %] ou 0	22/06/2035	1 200	$ (55)	$ (61)	0,00

Tableau des investissements Fonds Commodity Real Return Fund (suite)

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant du notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,175 %	15/03/2023	1 800	$ (66)	$ (553)	(0,04)
BRC	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,558	02/02/2023	6 600	(151)	0	0,00
CBK	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,736	23/02/2023	13 000	(322)	0	0,00
DUB	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,340	17/11/2023	50 700	(639)	(3 286)	(0,24)
GLM	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,350	26/04/2023	11 700	(231)	(20)	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547	07/03/2023	2 500	(55)	(6)	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	2 500	(55)	(158)	(0,01)
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	3 200	(38)	(8)	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	3 200	(44)	(105)	(0,01)
JPM	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,785	25/01/2023	13 900	(384)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,175	15/03/2023	1 800	(65)	(553)	(0,04)
MYC	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,579	31/01/2023	6 600	(154)	0	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,350	31/05/2023	32 900	(717)	(97)	(0,01)
							$ (2 921)	$ (4 786)	(0,35)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE DE CRÉDIT SUR INDICES DE CRÉDIT – VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant du notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
DUB	Indice CMBX.NA.AAA.8	0,500 %	17/10/2057	$ 1 500	$ (104)	$ 105	$ 1	0,00
GST	Indice CMBX.NA.AAA.8	0,500	17/10/2057	1 800	(94)	96	2	0,00
SAL	Indice CMBX.NA.AAA.12	0,500	17/08/2061	700	(1)	(5)	(6)	0,00
					$ (199)	$ 196	$ (3)	0,00

(1) Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(2) Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, tel que défini par les termes de ce contrat de swap précis.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Taux variable à payer/recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,998 %	20/06/2028	ILS 890	$ 0	$ (18)	$ (18)	0,00
BRC	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,950	20/06/2028	810	0	(17)	(17)	0,00
CKL	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	2,100	20/06/2028	750	(2)	(12)	(14)	0,00
GLM	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,971	16/02/2028	1 430	0	(26)	(26)	(0,01)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,998	20/06/2028	610	0	(13)	(13)	0,00
HUS	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,998	20/06/2028	480	0	(10)	(10)	0,00
						$ (2)	$ (96)	$ (98)	(0,01)

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

Contrepartie	À payer/recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel	Date d'échéance	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	À recevoir	Indice BCOMTR	1 365 724	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	$ 338 139	15/02/2023	$ 0	$ (2 955)	$ (2 955)	(0,21)
CBK	À recevoir	Indice BCOMTR	544 691	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	134 860	15/02/2023	0	(1 178)	(1 178)	(0,09)
	À recevoir	Indice CIXBSTR3	324 655	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	89 432	15/02/2023	0	(1 279)	(1 279)	(0,09)
CIB	À recevoir	Indice BCOMTR	154 350	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	38 215	15/02/2023	0	(334)	(334)	(0,02)
FBF	À recevoir	Indice BCOMTR	83 595	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	20 697	15/02/2023	0	(181)	(181)	(0,01)
GST	À recevoir	Indice BCOMF1TC	226 031	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	91 078	15/02/2023	0	(794)	(794)	(0,06)
	À recevoir	Indice BCOMTR	1 162 316	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	287 777	15/02/2023	0	(2 516)	(2 516)	(0,18)
	À recevoir	Indice BCOMTR2	56 072	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	14 223	15/02/2023	0	(166)	(166)	(0,01)
JPM	À recevoir	Indice BCOMF1TC	421 556	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	88 842	15/02/2023	0	(775)	(775)	(0,06)
	À recevoir	Indice BCOMTR	485 976	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	120 323	15/02/2023	0	(1 064)	(1 064)	(0,08)
	À recevoir	Indice JMABDEWU	494 170	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	76 584	15/02/2023	0	1 006	1 006	0,07
	À recevoir	Indice JMABNIU5	75 812	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	13 445	15/02/2024	0	488	488	0,04

Contrepartie	À payer/recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel	Date d'échéance	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
MAC	À recevoir	Indice PIMCODBU	269 229	0,160 %	$ 42 461	15/03/2023	$ 0	$ 1 137	$ 1 137	0,08
MEI	À recevoir	Indice BCOMTR	116 009	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	28 723	15/02/2023	0	(251)	(251)	(0,02)
SOG	À recevoir	Indice BCOMTR	229 778	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	56 891	15/02/2023	0	(497)	(497)	(0,04)
							$ 0	$ (9 359)	$ (9 359)	(0,68)

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€	72	$	76	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$	1 027	¥	135 400	0	0	0	0,00
BPS	01/2023	ILS	576	$	168	5	0	5	0,00
	01/2023	$	1 056	€	991	2	0	2	0,00
	03/2023	PEN	3 733	$	960	0	(12)	(12)	0,00
BRC	01/2023	£	28 236		34 361	391	0	391	0,03
	01/2023	SEK	124 706		11 907	0	(66)	(66)	0,00
	01/2023	SGD	436		324	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	1 132	€	1 064	4	0	4	0,00
CBK	01/2023	AUD	253	$	172	1	0	1	0,00
	01/2023	DKK	6 235		878	0	(17)	(17)	0,00
	01/2023	¥	143 300		1 040	0	(47)	(47)	0,00
	01/2023	SEK	9 960		956	0	0	0	0,00
	01/2023	$	2 370	DKK	16 715	30	0	30	0,00
	01/2023		3 208	€	3 022	19	0	19	0,00
	01/2023		45	PEN	182	2	0	2	0,00
	03/2023		66		267	3	0	3	0,00
DUB	01/2023	DKK	203 661	$	28 705	0	(538)	(538)	(0,04)
JPM	01/2023	£	73 338		88 557	325	0	325	0,02
	01/2023	$	1 339	DKK	9 560	34	0	34	0,00
MBC	01/2023	AUD	311	$	209	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	CAD	3 623		2 701	27	0	27	0,00
	01/2023	DKK	184 169		26 015	0	(428)	(428)	(0,03)
	01/2023	€	287 785		301 633	0	(5 637)	(5 637)	(0,41)
	01/2023	¥	1 527 641		11 095	0	(491)	(491)	(0,04)
	01/2023	$	4 603	€	4 372	64	0	64	0,00
MYI	01/2023	AUD	9 865	$	6 625	0	(67)	(67)	0,00
	01/2023	€	5		5	0	0	0	0,00
	01/2023	£	46		56	0	0	0	0,00
	01/2023	¥	7 290 955		53 181	0	(2 114)	(2 114)	(0,15)
	01/2023	SGD	7		5	0	0	0	0,00
	01/2023	$	550	€	517	1	0	1	0,00
	01/2023		48	SGD	65	0	0	0	0,00
RBC	01/2023	AUD	114	$	76	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01/2023		661		446	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	NZD	3 103		1 933	0	(30)	(30)	0,00
	01/2023	$	798	€	749	2	0	2	0,00
	01/2023		337	£	279	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		48	PEN	185	0	0	0	0,00
	03/2023		47		182	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	ILS	7	$	2	0	0	0	0,00
	01/2023	SEK	7 956		760	0	(4)	(4)	0,00
						$ 910	$ (9 459)	$ (8 549)	(0,62)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de Capitalisation et E en EUR (couverte) de Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€	6 838	$	7 211	$ 0	$ (89)	$ (89)	(0,01)
BPS	01/2023		1 003		1 070	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01/2023		2 773		2 949	0	(11)	(11)	0,00
	01/2023	$	170 634	€	164 351	4 845	0	4 845	0,34
MBC	01/2023	€	3 255	$	3 451	0	(26)	(26)	0,00
	01/2023	$	173 854	€	165 877	3 254	0	3 254	0,24
RYL	01/2023	€	51	$	54	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	$	163 481	€	157 065	4 218	0	4 218	0,31
						$ 12 317	$ (127)	$ 12 190	0,88

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£	34	$	42	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$	15 599	£	12 956	0	(11)	(11)	0,00
BPS	01/2023	£	34	$	41	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	$	45	£	37	0	0	0	0,00
JPM	01/2023		15 943		13 203	0	(58)	(58)	0,00
MBC	01/2023	£	21	$	26	0	0	0	0,00
	01/2023	$	16 420	£	13 698	69	(9)	60	0,00
MYI	01/2023	£	664	$	809	10	0	10	0,00
	01/2023	$	784	£	638	0	(17)	(17)	0,00
UAG	01/2023	£	12	$	15	1	0	1	0,00
						$ 80	$ (95)	$ (15)	0,00

Au 31 décembre 2022, la Catégorie d'actions de capitalisation de Classe E couverte en SGD avait en cours les contrats de change à terme suivants :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	935	SGD	1 282	$ 21	$ 0	$ 21	0,00
BPS	01/2023		947		1 299	22	0	22	0,00
GSC	01/2023	SGD	1 129	$	832	0	(10)	(10)	0,00
	01/2023	$	383	SGD	523	7	0	7	0,00
MBC	01/2023	SGD	87	$	64	0	0	0	0,00
	01/2023	$	953	SGD	1 303	19	0	19	0,00
MYI	01/2023	SGD	685	$	507	0	(3)	(3)	0,00
UAG	01/2023		394		287	0	(7)	(7)	0,00
	01/2023	$	10	SGD	13	0	0	0	0,00
						$ 69	$ (20)	$ 49	0,00

Total des instruments financiers dérivés hors cote	**$ (7 607)**	**(0,56)**
Total des investissements	**$ 1 805 420**	**131,79**
Autres actifs et passifs courants	**$ (435 543)**	**(31,79)**
Actifs nets	**$ 1 369 877**	**100,00**

ANNEXES À L'ÉTAT DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

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

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

(c) Affilié au Fonds.

(d) Titre convertible conditionnel.

(e) Des titres d'une juste valeur globale de 400 193 $ (31 décembre 2021 : 23 024 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

(f) Des titres d'une juste valeur globale de 17 272 $ (31 décembre 2021 : 80 697 $) ont été nantis ou livrés en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2022.

Des titres d'une juste valeur globale de 157 $ (31 décembre 2021 : 0 $) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 19 275 $ (31 décembre 2021 : 7 875 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 18 770 $ (31 décembre 2021 : 2 190 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Mesures de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 0	$ 1 750 918	$ 0	$ 1 750 918
Fonds d'investissement	120	0	0	120
Contrats de mise en pension	0	59 113	0	59 113
Instruments financiers dérivés[3]	8 938	(13 669)	0	(4 731)
Totaux	**$ 9 058**	**$ 1 796 362**	**$ 0**	**$ 1 805 420**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 0	$ 1 554 523	$ 0	$ 1 554 523
Fonds d'investissement	18	0	0	18
Contrats de mise en pension	0	2 098	0	2 098
Instruments financiers dérivés[3]	3 330	52 131	0	55 461
Totaux	**$ 3 348**	**$ 1 608 752**	**$ 0**	**$ 1 612 100**

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

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

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

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	En % de l'actif net
BOS	4,430 %	12/12/2022	05/01/2023	$ (484)	$ (485)	(0,04)
CIB	4,200	17/11/2022	11/01/2023	(82 025)	(82 455)	(6,02)
	4,200	23/11/2022	11/01/2023	(184 275)	(185 114)	(13,51)
	4,370	08/12/2022	05/01/2023	(32 093)	(32 186)	(2,35)
	4,400	05/01/2023	19/01/2023	(32 221)	(32 221)	(2,35)
GRE	4,360	07/12/2022	05/01/2023	(60 953)	(61 137)	(4,46)
	4,430	12/12/2022	05/01/2023	(6 534)	(6 550)	(0,48)
RCY	4,250	10/11/2022	24/01/2023	(25 000)	(25 154)	(1,84)
Total des contrats de prise en pension					**$ (425 302)**	**(31,05)**

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos[1]	En % de l'actif net
BOS	4,210 %	09/11/2022	09/01/2023	$(17 846)	$ (17 959)	(1,31)
Opérations de financement de vente et rachat dos-à-dos					**$ (17 959)**	**(1,31)**

(1) Le montant à payer sur opération par vente et rachat dos-à-dos comprend 15 $ de baisse de prix différée.

Garantie (reçue)/nantie d'instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Juste valeur totale des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Juste valeur totale des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ (97)	$ 0	$ (97)	$ 245	$ (270)	$ (25)
BPS	(3 167)	4 390	1 223	9 902	(10 590)	(688)
BRC	311	(320)	(9)	(2)	0	(2)
CBK	2 368	(1 310)	1 058	6 162	(6 720)	(558)
CIB	(334)	470	136	1 202	(1 500)	(298)
CKL	(14)	0	(14)	21	0	21
DUB	(1 532)	1 480	(52)	(1)	0	(1)
FBF	(181)	80	(101)	651	(840)	(189)
GLM	(384)	260	(124)	36	(110)	(74)
GSC	(3)	0	(3)	(2)	0	(2)
GST	(3 474)	4 890	1 416	11 226	(12 030)	(804)
HUS	(10)	0	(10)	249	0	249
JPM	(272)	1 520	1 248	20 479	(21 410)	(931)
MAC	1 137	(840)	297	1 646	(1 770)	(124)
MBC	(3 160)	2 770	(390)	S/O	S/O	S/O
MEI	(251)	320	69	2 152	(2 310)	(158)
MYC	(26)	260	234	(28)	(16)	(44)
MYI	(2 190)	1 630	(560)	290	(440)	(150)
NAB	S/O	S/O	S/O	352	(280)	72
RBC	(1)	0	(1)	1 543	(1 210)	333
SAL	(6)	100	94	(33)	0	(33)
SCX	4 186	(4 010)	176	(2 717)	2 190	(527)
SOG	(497)	570	73	859	(1 150)	(291)
TOR	S/O	S/O	S/O	1 244	(980)	264
UAG	(10)	30	20	40	0	40

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

Informations comparatives

Ce qui suit est une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières négociables admises à la cote sur une Bourse officielle	108,79	89,98
Valeurs mobilières négociables négociées sur un autre marché réglementé	18,76	17,17
Autres valeurs mobilières négociables	0,26	0,49
Fonds d'investissement	0,01	0,00
Contrats de mise en pension	4,32	0,15
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,64	0,14
Instruments financiers dérivés compensés	(0,43)	(0,14)
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,56)	3,84
Contrats de prise en pension	(31,05)	(1,59)
Opérations de financement de vente et rachat dos-à-dos	(1,31)	(5,59)

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Australie	0,51	0,60
Canada	0,18	0,20
Îles Caïmans	5,01	0,45
Danemark	3,73	4,57
France	5,36	7,69
Allemagne	1,07	S/O
Guernesey, Îles anglo-normandes	S/O	0,03
Irlande	4,58	3,94
Italie	6,97	8,33
Japon	4,89	4,77
Pays-Bas	0,03	0,03
Nouvelle-Zélande	0,14	0,15
Pérou	0,04	0,10
Qatar	0,02	0,04
Arabie saoudite	0,02	0,02
Espagne	3,61	0,56
Suède	0,99	1,06
Royaume-Uni	8,89	6,62
États-Unis	81,68	68,48
Instruments à court terme	0,09	S/O
Fonds d'investissement	0,01	0,00
Contrats de mise en pension	4,32	0,15
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,64	0,14
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(0,43)	(0,14)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,22	0,08
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Options plafonnées sur l'inflation	0,00	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,35)	(0,10)
Options sur titres	S/O	(0,01)
Swaps de défaillance de crédit sur indices de crédit — vente de protection	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(0,01)	0,01
Swaps de rendement total sur indices	(0,68)	3,70
Contrats de change à terme	(0,62)	(0,17)
Contrats de change à terme couverts	0,88	0,33
Autres actifs et passifs courants	(31,79)	(11,63)
Actifs nets	100,00	100,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES NÉGOCIABLES			
ARGENTINE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement argentin			
1,000 % éch. 09/07/2029	$ 13	$ 3	0,00
3,500 % éch. 09/07/2041	800	230	0,24
Provincia de Buenos Aires			
72,913 % éch. 12/04/2025 (a)	ARS 20	0	0,00
Total Argentine		233	0,24
AUSTRALIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Santos Finance Ltd.			
3,649 % éch. 29/04/2031	$ 1 100	875	0,90
Virgin Australia Holdings Pty. Ltd			
8,125 % éch. 15/11/2024 ^	377	2	0,00
Total Australie		877	0,90
BRÉSIL			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Vale Overseas Ltd.			
6,875 % éch. 10/11/2039	375	396	0,41
CANADA			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Air Canada			
3,875 % éch. 15/08/2026	1 025	910	0,94
ÎLES CAÏMANS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Kaisa Group Holdings Ltd.			
11,500 % éch. 30/01/2023 ^	600	84	0,09
Sands China Ltd.			
4,875 % éch. 18/06/2030	300	264	0,27
Sunac China Holdings Ltd.			
5,950 % éch. 26/04/2024 ^	450	99	0,10
Wynn Macau Ltd.			
5,500 % éch. 01/10/2027	200	175	0,18
Total Îles Caïmans		622	0,64
CHINE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Yango Justice International Ltd.			
7,500 % éch. 15/04/2024 ^	200	8	0,01
9,250 % éch. 15/04/2023 ^	200	7	0,01
Total Chine		15	0,02
FRANCE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
BNP Paribas S.A.			
3,132 % éch. 20/01/2033	600	475	0,49
7,750 % éch. 16/08/2029 (f)(h)	200	198	0,20
Société Générale S.A.			
3,337 % éch. 21/01/2033	450	356	0,37
Total France		1 029	1,06
ITALIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Intesa Sanpaolo SpA			
4,950 % éch. 01/06/2042	200	129	0,13
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA			
3,500 % éch. 09/10/2025	€ 200	198	0,21
Total Italie		327	0,34
JAPON			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			
5,133 % éch. 20/07/2033	$ 500	479	0,49
Nomura Holdings, Inc.			
2,999 % éch. 22/01/2032	375	295	0,31
Total Japon		774	0,80

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
LUXEMBOURG			
ACTIONS ORDINAIRES			
Intelsat Emergence S.A. (c)(i)	7 480	$ 180	0,18
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature)			
3,000 % éch. 31/12/2026 (b)	$ 511	302	0,31
Intelsat Jackson Holdings S.A.			
6,500 % éch. 15/03/2030	562	504	0,52
		806	0,83
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			
Intelsat Jackson Holdings S.A.			
7,445 % éch. 01/02/2029	147	142	0,15
	ACTIONS		
DROITS			
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05/12/2025	1 566	11	0,01
Total Luxembourg		1 139	1,17
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
MULTINATIONAL			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Delta Air Lines, Inc.			
4,750 % éch. 20/10/2028	$ 400	376	0,39
NXP BV			
3,250 % éch. 11/05/2041	875	614	0,63
Total Multinational		990	1,02
PAYS-BAS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
LeasePlan Corp. NV			
7,375 % éch. 29/05/2024 (f)(h)	€ 700	742	0,76
Prosus NV			
3,832 % éch. 08/02/2051	$ 300	182	0,19
Total Pays-Bas		924	0,95
PÉROU			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement péruvien			
6,350 % éch. 12/08/2028	PEN 2 900	724	0,74
QATAR			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement qatari			
3,750 % éch. 16/04/2030	$ 400	388	0,40
AFRIQUE DU SUD			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement sud-africain			
10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR 26 800	1 665	1,71
ESPAGNE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Cellnex Finance Co. S.A.			
1,500 % éch. 08/06/2028	€ 400	356	0,37
SUISSE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Credit Suisse Group AG			
6,442 % éch. 11/08/2028	$ 400	365	0,37
6,537 % éch. 12/08/2033	250	220	0,23
UBS Group AG			
4,988 % éch. 05/08/2033	500	464	0,48
Total Suisse		1 049	1,08

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ROYAUME-UNI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Barclays PLC			
5,746 % éch. 09/08/2033	$ 500	$ 474	0,49
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC			
2,950 % éch. 27/01/2029	500	347	0,36
Grainger PLC			
3,000 % éch. 03/07/2030	£ 200	181	0,18
HSBC Holdings PLC			
4,600 % éch. 17/12/2030 (f)(h)	$ 300	234	0,24
5,402 % éch. 11/08/2033	250	232	0,24
INEOS Quattro Finance PLC			
2,500 % éch. 15/01/2026	€ 100	91	0,09
John Lewis PLC			
4,250 % éch. 18/12/2034	£ 300	220	0,23
Market Bidco Finco PLC			
4,750 % éch. 04/11/2027	€ 800	689	0,71
UNITE Group PLC			
3,500 % éch. 15/10/2028	£ 200	204	0,21
Virgin Media Secured Finance PLC			
4,125 % éch. 15/08/2030	300	277	0,28
Vmed O2 UK Financing PLC			
3,250 % éch. 31/01/2031	€ 375	320	0,33
Total Royaume-Uni		3 269	3,36
ÉTATS-UNIS			
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS			
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
5,214 % éch. 25/12/2045 ^	$ 290	224	0,23
Argent Securities Trust			
4,539 % éch. 25/09/2036	768	256	0,26
4,749 % éch. 25/04/2036	270	90	0,09
4,949 % éch. 25/04/2036	661	220	0,23
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
5,214 % éch. 25/06/2036	34	34	0,03
Citigroup Mortgage Loan Trust			
4,549 % éch. 25/12/2036	1 652	932	0,96
First Franklin Mortgage Loan Trust			
5,814 % éch. 25/10/2034	315	309	0,32
GSAMP Trust			
4,479 % éch. 25/01/2037	380	231	0,24
4,509 % éch. 25/12/2036	536	268	0,28
4,619 % éch. 25/12/2046	661	332	0,34
MASTR Asset-Backed Securities Trust			
4,869 % éch. 25/08/2036	483	196	0,20
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
4,509 % éch. 25/11/2037	71	25	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
4,519 % éch. 25/01/2037	352	175	0,18
4,529 % éch. 25/10/2036	274	132	0,14
4,689 % éch. 25/09/2036	1 786	685	0,70
4,849 % éch. 25/09/2036	60	27	0,03
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust			
4,489 % éch. 25/04/2037	63	35	0,04
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
6,465 % éch. 25/09/2046 ^	639	245	0,25
New Century Home Equity Loan Trust			
7,389 % éch. 25/01/2033 ^	66	56	0,06
NovaStar Mortgage Funding Trust			
4,689 % éch. 25/06/2036	529	407	0,42
4,689 % éch. 25/09/2036	856	373	0,38
Option One Mortgage Loan Trust			
4,639 % éch. 25/03/2037	508	250	0,26
Residential Asset Mortgage Products Trust			
4,849 % éch. 25/12/2035	1 131	961	0,99
Residential Asset Securities Corp. Trust			
4,466 % éch. 25/08/2034	376	360	0,37
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
5,349 % éch. 25/01/2036 ^	121	115	0,12
Soundview Home Loan Trust			
4,569 % éch. 25/07/2037	256	231	0,24
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
4,689 % éch. 25/09/2037	356	248	0,25
		7 417	7,63

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

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ACTIONS ORDINAIRES			
ÉNERGIE			
Constellation Oil Services Holding S.A. « B » (c)(i)	580 149	$ 63	0,06
ÉTATS FINANCIERS			
Stearns Holdings LLC « B » (c)	157 159	0	0,00
Total Actions ordinaires		63	0,06

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Alleghany Corp.			
3,250 % éch. 15/08/2051	$ 225	159	0,16
Allstate Corp.			
5,750 % éch. 15/08/2053	100	94	0,10
American Airlines Pass-Through Trust			
3,375 % éch. 01/11/2028	375	314	0,32
3,600 % éch. 22/03/2029	138	124	0,13
American Homes 4 Rent LP			
3,375 % éch. 15/07/2051	600	376	0,39
American Tower Corp.			
2,700 % éch. 15/04/2031	300	245	0,25
2,950 % éch. 15/01/2051	1 125	701	0,72
Aviation Capital Group LLC			
3,500 % éch. 01/11/2027	400	350	0,36
Bank of America Corp.			
3,384 % éch. 02/04/2026	200	191	0,20
5,015 % éch. 22/07/2033	1 350	1 286	1,32
Boeing Co.			
3,950 % éch. 01/08/2059	600	405	0,42
5,705 % éch. 01/05/2040	600	575	0,59
5,805 % éch. 01/05/2050	100	93	0,10
Broadcom, Inc.			
3,187 % éch. 15/11/2036	5	4	0,00
3,469 % éch. 15/04/2034	525	420	0,43
4,150 % éch. 15/04/2032	675	594	0,61
Centene Corp.			
2,450 % éch. 15/07/2028	625	529	0,54
4,250 % éch. 15/12/2027	100	94	0,10
Charter Communications Operating LLC			
3,950 % éch. 30/06/2062	475	282	0,29
Cheniere Energy Partners LP			
4,500 % éch. 01/10/2029	700	631	0,65
Chesapeake Energy Corp.			
5,500 % éch. 01/02/2026	100	97	0,10
Cinemark USA, Inc.			
5,250 % éch. 15/07/2028	500	372	0,38
Citigroup, Inc.			
3,785 % éch. 17/03/2033 (i)	900	772	0,79
6,270 % éch. 17/11/2033 (i)	900	931	0,96
Continental Resources, Inc.			
5,750 % éch. 15/01/2031	500	466	0,48
Crown Castle, Inc.			
2,250 % éch. 15/01/2031	1 200	965	0,99
DAE Funding LLC			
1,550 % éch. 01/08/2024	800	744	0,77
DCP Midstream Operating LP			
3,250 % éch. 15/02/2032	200	166	0,17
Delta Air Lines, Inc.			
7,375 % éch. 15/01/2026	175	179	0,18
Diamond Sports Group LLC			
5,375 % éch. 15/08/2026	400	47	0,05
Duke Energy Corp.			
4,500 % éch. 15/08/2032	100	94	0,10
5,000 % éch. 15/08/2052	100	89	0,09
Edison International			
6,950 % éch. 15/11/2029	100	105	0,11
Endeavor Energy Resources LP			
5,750 % éch. 30/01/2028	325	312	0,32
Energy Transfer LP			
5,000 % éch. 15/05/2044	300	246	0,25
Entergy Corp.			
3,750 % éch. 15/06/2050	100	74	0,08
EQM Midstream Partners LP			
4,500 % éch. 15/01/2029	100	84	0,09
4,750 % éch. 15/01/2031	$ 300	$ 246	0,25
7,500 % éch. 01/06/2030	100	96	0,10
EQT Corp.			
5,000 % éch. 15/01/2029	325	306	0,32
Equinix, Inc.			
3,000 % éch. 15/07/2050	450	284	0,29
Expedia Group, Inc.			
3,250 % éch. 15/02/2030	400	340	0,35
FirstEnergy Transmission LLC			
4,350 % éch. 15/01/2025	325	317	0,33
Foundation Building Materials, Inc.			
6,000 % éch. 01/03/2029	175	132	0,14
Freeport-McMoRan, Inc.			
5,250 % éch. 01/09/2029	221	214	0,22
Global Atlantic Fin Co.			
3,125 % éch. 15/06/2031	300	221	0,23
Global Payments, Inc.			
5,400 % éch. 15/08/2032	600	573	0,59
5,950 % éch. 15/08/2052	400	364	0,37
GLP Capital LP			
4,000 % éch. 15/01/2030	1 100	965	0,99
Goldman Sachs Group, Inc.			
4,482 % éch. 23/08/2028	900	864	0,89
Goodman U.S. Finance Five LLC			
4,625 % éch. 04/05/2032	50	46	0,05
HCA, Inc.			
3,500 % éch. 01/09/2030	350	303	0,31
4,625 % éch. 15/03/2052	725	568	0,58
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC			
4,875 % éch. 01/07/2031	100	82	0,08
Host Hotels & Resorts LP			
2,900 % éch. 15/12/2031	500	384	0,40
3,375 % éch. 15/12/2029	100	84	0,09
3,500 % éch. 15/09/2030	925	765	0,79
Hyatt Hotels Corp.			
4,375 % éch. 15/09/2028	100	92	0,09
Infor, Inc.			
1,450 % éch. 15/07/2023	100	98	0,10
JPMorgan Chase & Co.			
4,912 % éch. 25/07/2033	1 400	1 337	1,38
5,000 % éch. 01/08/2024 (f)	100	92	0,09
Leidos, Inc.			
2,300 % éch. 15/02/2031	400	307	0,32
Manitowoc Co., Inc.			
9,000 % éch. 01/04/2026	500	471	0,48
Mileage Plus Holdings LLC			
6,500 % éch. 20/06/2027	90	90	0,09
Moody's Corp.			
3,100 % éch. 29/11/2061	475	301	0,31
Morgan Stanley			
4,889 % éch. 20/07/2033	1 450	1 367	1,41
6,342 % éch. 18/10/2033	50	52	0,05
MSCI, Inc.			
3,625 % éch. 01/11/2031	1 400	1 160	1,19
4,000 % éch. 15/11/2029	100	87	0,09
Netflix, Inc.			
5,375 % éch. 15/11/2029	1 300	1 263	1,30
Newell Brands, Inc.			
4,450 % éch. 01/04/2026	325	306	0,31
Pacific Gas & Electric Co.			
2,500 % éch. 01/02/2031	200	156	0,16
3,150 % éch. 01/01/2026	300	279	0,29
3,950 % éch. 01/12/2047 ^	425	290	0,30
4,550 % éch. 01/07/2030	100	91	0,09
Park River Holdings, Inc.			
5,625 % éch. 01/02/2029	430	287	0,30
SBA Communications Corp.			
3,125 % éch. 01/02/2029	200	167	0,17
Sealed Air Corp.			
1,573 % éch. 15/10/2026	350	303	0,31
Service Properties Trust			
7,500 % éch. 15/09/2025	500	477	0,49
Southern California Edison Co.			
3,650 % éch. 01/02/2050	400	294	0,30
5,850 % éch. 01/11/2027	100	103	0,11
Sprint LLC			
7,875 % éch. 15/09/2023	$ 600	$ 610	0,63
Sysco Corp.			
3,150 % éch. 14/12/2051	425	281	0,29
T-Mobile USA, Inc.			
2,625 % éch. 15/04/2026	350	321	0,33
3,600 % éch. 15/11/2060	575	382	0,39
Take-Two Interactive Software, Inc.			
4,000 % éch. 14/04/2032	325	289	0,30
Time Warner Cable Enterprises LLC			
8,375 % éch. 15/07/2033	100	111	0,11
Travel + Leisure Co.			
6,000 % éch. 01/04/2027	325	309	0,32
6,625 % éch. 31/07/2026	100	98	0,10
United Airlines Pass-Through Trust			
3,750 % éch. 03/03/2028	122	112	0,12
United Airlines, Inc.			
4,375 % éch. 15/04/2026	100	93	0,10
Venture Global Calcasieu Pass LLC			
3,875 % éch. 15/08/2029	1 625	1 425	1,47
3,875 % éch. 01/11/2033	300	246	0,25
VeriSign, Inc.			
2,700 % éch. 15/06/2031	700	572	0,59
VICI Properties LP			
3,875 % éch. 15/02/2029	1 125	988	1,02
4,250 % éch. 01/12/2026	100	93	0,10
Wells Fargo & Co.			
3,526 % éch. 24/03/2028	100	93	0,10
4,897 % éch. 25/07/2033	1 100	1 048	1,08
Weyerhaeuser Co.			
4,000 % éch. 09/03/2052	1 125	854	0,88
7,375 % éch. 15/03/2032	99	110	0,11
White Cap Parent LLC (8,250 % en numéraire ou 8,250 % de rémunération en nature)			
8,250 % éch. 15/03/2026 (b)	550	476	0,49
		38 345	39,47
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC			
6,603 % éch. 01/12/2027	196	196	0,20
Buckeye Partners LP			
6,634 % éch. 01/11/2026	986	982	1,01
Foundation Building Materials Holding Co. LLC			
7,665 % éch. 31/01/2028	398	378	0,39
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.			
8,165 % éch. 16/11/2025	936	884	0,91
Tibco Software, Inc.			
9,180 % éch. 30/03/2029	100	90	0,09
USI, Inc.			
7,980 % éch. 02/12/2026	970	965	1,00
		3 495	3,60
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES			
Banc of America Funding Trust			
6,000 % éch. 25/07/2037	201	156	0,16
BCAP LLC Trust			
4,829 % éch. 25/05/2047 ^	164	154	0,16
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
3,474 % éch. 25/07/2036 ^	46	40	0,04
Countrywide Alternative Loan Trust			
3,448 % éch. 25/08/2035	12	11	0,01
4,543 % éch. 20/09/2046	8	7	0,01
4,769 % éch. 25/09/2046 ^	5	5	0,01
5,500 % éch. 25/12/2035 ^	268	153	0,16
5,689 % éch. 25/10/2035 ^	12	9	0,01
6,000 % éch. 25/08/2037 ^	118	92	0,10
6,500 % éch. 25/08/2037 ^	1 883	831	0,86
7,731 % éch. 25/07/2035	149	140	0,14
10,845 % éch. 25/09/2037	295	269	0,28
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
3,031 % éch. 25/09/2037 ^	71	65	0,07
5,750 % éch. 25/07/2037 ^	7	4	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
6,000 % éch. 25/09/2035	232	87	0,09
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates			
3,176 % éch. 29/12/2037	643	412	0,42

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust			
6,000 % éch. 25/07/2036	$ 146	$78	0,08
6,500 % éch. 25/10/2021 ^	157	12	0,01
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust			
4,529 % éch. 25/07/2047	13	12	0,01
4,539 % éch. 25/02/2047	3 226	1 911	1,97
4,769 % éch. 25/10/2036 ^	175	60	0,06
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust			
2,693 % éch. 25/08/2035 ^	13	11	0,01
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust			
3,592 % éch. 25/08/2035 ^	5	4	0,00
Impac Secured Assets Trust			
4,689 % éch. 25/11/2036	61	60	0,06
IndyMac Mortgage Loan Trust			
3,088 % éch. 25/05/2037 ^	57	48	0,05
3,140 % éch. 25/12/2034	244	234	0,24
4,889 % éch. 25/02/2037	23	15	0,02
JPMorgan Mortgage Trust			
6,500 % éch. 25/07/2036 ^	243	109	0,11
Lehman XS Trust			
4,749 % éch. 25/07/2037 ^	284	255	0,26
4,944 % éch. 25/08/2047 ^	193	166	0,17
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
2,980 % éch. 25/11/2037	198	130	0,13
Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
3,839 % éch. 25/07/2035	2	2	0,00
4,506 % éch. 25/12/2035 ^	17	13	0,01
4,739 % éch. 25/08/2035 ^	21	17	0,02
5,139 % éch. 25/11/2036 ^	551	408	0,42
Residential Asset Securitization Trust			
5,750 % éch. 25/03/2037 ^	227	75	0,08
6,000 % éch. 25/02/2036	323	146	0,15
6,250 % éch. 25/11/2036 ^	480	190	0,20
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
4,869 % éch. 25/05/2037 ^	$ 83	$ 72	0,07
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
4,466 % éch. 25/05/2035 ^	1 335	1 138	1,17
		7 601	7,82
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Freddie Mac			
5,992 % éch. 25/11/2055	641	394	0,41
Ginnie Mae, TBA			
2,500 % éch. 01/02/2053	200	174	0,18
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % éch. 01/01/2053	100	81	0,08
2,500 % éch. 01/01/2053	1 100	932	0,96
3,000 % éch. 01/02/2053	100	88	0,09
4,000 % éch. 01/02/2053	1 100	1 032	1,06
		2 701	2,78
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Billets du Trésor américain			
2,750 % éch. 15/08/2032	800	729	0,75
3,125 % éch. 31/08/2027	3 825	3 679	3,79
		4 408	4,54
	ACTIONS		
BONS DE SOUSCRIPTION			
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31/12/2060	753	0	0,00
Vistra Corp. - Exp. 02/02/2024	31 815	8	0,01
		8	0,01
Total États-Unis		64 038	65,91

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÎLES VIERGES BRITANNIQUES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Studio City Finance Ltd.			
5,000 % éch. 15/01/2029	$ 300	$ 222	0,23
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BONS DU TRÉSOR HONGROIS			
18,250 % éch. 03/01/2023 (d)(e)	HUF 93 000	248	0,26
Total instruments à court terme		248	0,26
Total des valeurs mobilières		**$ 80 195**	**82,55**
	ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	917 209	9 130	9,40
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (g)	9 239	123	0,12
		9 253	**9,52**
FONDS INDICIELS COTÉS			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)	4 000	396	0,41
Total Fonds d'investissement		**$9 649**	**9,93**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux directeur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Accords de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BPS	4,100 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 6 300	Billet du Trésor américain 1,625 % échéance 15/05/2031	$ (6 438)	$ 6 300	$ 6 303	6,48
FICC	1,900	30/12/2022	03/01/2023	610	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 29/06/2023	(622)	610	610	0,63
Total des contrats de mise en pension						**$ (7 060)**	**$ 6 910**	**$ 6 913**	**7,11**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	À découvert	03/2024	50	$ 237	0,24
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	À découvert	01/2023	1	1	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	À découvert	03/2023	4	37	0,04
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	À découvert	01/2023	1	(5)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	À découvert	03/2023	10	(3)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Longue	03/2023	20	(1)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	À découvert	03/2023	114	112	0,12
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	À découvert	03/2023	53	(2)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	À découvert	03/2023	14	(4)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	À découvert	03/2023	11	22	0,02
				$ 394	0,41
Total des instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé				**$ 394**	**0,41**

(1) Option de style contrat à terme standardisé.

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

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant du notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Anheuser-Busch InBev S.A.	(1,000) %	20/12/2023	€ 1 300	$ 18	0,02
AutoZone, Inc.	(1,000)	20/06/2024	$ 1 400	21	0,02
Bath & Body Works, Inc.	(1,000)	20/12/2023	350	(26)	(0,03)
ConocoPhillips	(1,000)	20/12/2024	100	(1)	0,00
Johnson Controls International PLC	(1,000)	20/12/2024	1 500	31	0,03
Lowe's Cos., Inc.	(1,000)	20/12/2023	700	11	0,01
Tyson Foods, Inc.	(1,000)	20/06/2024	1 400	25	0,03
				$ 79	0,08

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[2]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant du notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AT&T, Inc.	1,000 %	20/06/2027	$ 100	$ 1	0,00
Bombardier, Inc.	5,000	20/12/2024	200	14	0,01
MetLife, Inc.	1,000	20/12/2024	100	(1)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/06/2025	€ 100	17	0,02
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2025	200	8	0,01
Toll Brothers Finance Corp.	1,000	20/06/2026	$ 200	(2)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2027	100	1	0,00
				$ 38	0,04

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir[4]	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	2,000 %	15/03/2033	£ 900	$ (21)	(0,02)
À recevoir[4]	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053	100	1	0,00
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,000	15/09/2027	¥ 94 200	19	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,050	14/12/2052	$ 300	11	0,01
À payer	BRL-CDI à 1 an	11,700	04/01/2027	BRL 4 900	(23)	(0,02)
À recevoir	CNY-CNREPOFIX à 3 mois	2,250	21/12/2027	CNY 29 000	(2)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,270	04/11/2023	$ 12 400	(432)	(0,44)
À recevoir	ZAR-JIBAR à 3 mois	7,300	28/04/2027	ZAR 15 500	25	0,03
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	€ 600	(53)	(0,06)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	300	(27)	(0,03)
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	1 700	50	0,05
À payer	MXN-TIIE à 28 jours	5,140	24/03/2023	MXN 7 200	(5)	(0,01)
À payer	MXN-TIIE à 28 jours	5,345	13/06/2023	15 200	(20)	(0,02)
À payer	MXN-TIIE à 28 jours	5,400	05/03/2026	10 000	(54)	(0,06)
					$ (531)	(0,55)
Total des instruments financiers dérivés compensés					**$ (414)**	**(0,43)**

(1) Si le Fonds est acheteur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds recevra (i) de la part du vendeur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et livrera l'obligation de référence ou les titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, de titres ou autres obligations livrables, égal au montant nominal du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(2) Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(3) Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, tel que défini par les termes de ce contrat de swap précis.

(4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Voir note 2, Transactions sur titres et revenus sur investissements, dans les Notes relatives aux États financiers pour plus d'informations.

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

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

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	0,021 %	25/10/2023	1 500	$ 85	$ 377	0,39
BPS	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,000	15/03/2023	260	30	141	0,14
JPM	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,000	15/03/2023	180	20	98	0,10
							$ 135	$ 616	0,63

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente – Indice hors cote iTraxx Europe à 5 ans	Vente	3,000 %	15/03/2023	200	$ 0	$ 0	0,00

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,870 %	23/01/2023	100	$ (1)	$ 0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,320	23/01/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	0,020	25/10/2023	7 500	(86)	(591)	(0,61)
BPS	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,900	17/01/2023	100	0	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	17/01/2023	100	0	(2)	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,175	15/03/2023	790	(29)	(243)	(0,25)
GLM	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	12/01/2023	100	(1)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,550	12/01/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547	07/03/2023	200	(4)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	200	(4)	(12)	(0,01)
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	300	(4)	(1)	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	300	(4)	(10)	(0,01)
JPM	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,175	15/03/2023	550	(20)	(169)	(0,18)
MYC	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,070	23/01/2023	100	(1)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,520	23/01/2023	100	0	(1)	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,600	17/01/2023	100	(1)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,050	17/01/2023	100	(1)	(4)	0,00
							$ (158)	$ (1 035)	(1,06)

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant du notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat – Uniform Mortgage-Backed Security de gré à gré, TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	$ 101,891	05/01/2023	100	$ 0	$ 0	0,00
	Option de vente – Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote, TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	99,813	06/02/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat – Uniform Mortgage-Backed Security de gré à gré, TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	101,813	06/02/2023	100	(1)	0	0,00
JPM	Option de vente – Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote, TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	97,156	06/03/2023	200	(1)	(3)	(0,01)
	Option de vente – Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote, TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	98,766	06/03/2023	100	(1)	(2)	0,00
	Option d'achat – Uniform Mortgage-Backed Security de gré à gré, TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	100,766	06/03/2023	100	(1)	0	0,00
SAL	Option d'achat – Uniform Mortgage-Backed Security de gré à gré, TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	101,859	05/01/2023	100	0	0	0,00
					$ (5)	$ (6)	(0,01)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
CBK	Obligation internationale du gouvernement mexicain	(1,000) %	20/12/2023	$ 2 200	$ 25	$ (37)	$ (12)	(0,01)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[2]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BRC	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000 %	20/12/2024	$ 200	$ 1	$ 2	$ 3	0,00
	Pertamina Persero PT	1,000	20/12/2024	100	0	1	1	0,00
					$ 1	$ 3	$ 4	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE DE CRÉDIT SUR INDICES DE CRÉDIT – VENTE DE PROTECTION[2]

Contrepartie	Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant du notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
CBK	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000 %	20/12/2023	$ 100	$ 10	$ (6)	$ 4	0,01
GST	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000	20/12/2023	200	23	(14)	9	0,01
JPM	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000	20/12/2023	300	39	(26)	13	0,01
					$ 72	$ (46)	$ 26	0,03

(1) Si le Fonds est acheteur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds recevra (i) de la part du vendeur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et livrera l'obligation de référence ou les titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, de titres ou autres obligations livrables, égal au montant nominal du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(2) Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(3) Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, tel que défini par les termes de ce contrat de swap précis.

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

Contrepartie	À payer/recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel	Date d'échéance	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	À recevoir	Indice iBoxx USD Liquid High Yield	S/O	1,058 %	$ 4 800	20/03/2023	$ 1	$ (160)	$ (159)	(0,16)

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	02/2023	$	143	CHF	135	$ 4	$ 0	$ 4	0,01
	02/2023		121	NOK	1 196	1	0	1	0,00
	02/2023	ZAR	2 934	$	164	0	(8)	(8)	(0,01)
	03/2023		3 610		204	0	(6)	(6)	(0,01)
BPS	01/2023	HUF	91 660		236	0	(8)	(8)	(0,01)
	02/2023	$	13	IDR	197 480	0	0	0	0,00
	02/2023	ZAR	2 297	$	128	0	(7)	(7)	(0,01)
	03/2023	PEN	4 012		1 032	0	(13)	(13)	(0,01)
	03/2023	$	228	COP	1 113 540	0	(1)	(1)	0,00
	03/2023		99	MXN	1 987	2	0	2	0,00
BRC	01/2023	CNH	303	$	43	0	0	0	0,00
	02/2023	$	74	CHF	70	1	0	1	0,00
CBK	01/2023	CLP	173 768	$	195	0	(8)	(8)	(0,01)
	01/2023	$	98	BRL	517	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		182	CLP	173 709	22	0	22	0,02
	01/2023		51	€	48	0	0	0	0,00
	01/2023		54	ZAR	948	2	0	2	0,00
	02/2023	NOK	550	$	56	0	0	0	0,00
	02/2023	$	195	CLP	174 725	9	0	9	0,01
	02/2023		727	PEN	2 901	32	0	32	0,03
	03/2023	PEN	2 936	$	730	0	(36)	(36)	(0,03)
	03/2023	$	34	MXN	708	2	0	2	0,00
	04/2023		304	PEN	1 215	12	0	12	0,01
DUB	02/2023	ZAR	3 013	$	180	4	0	4	0,01
GLM	01/2023	BRL	517		97	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	CNH	314		45	0	0	0	0,00
	01/2023	ZAR	2 997		168	0	(8)	(8)	(0,01)
	03/2023	COP	1 113 540		231	4	0	4	0,01
	03/2023	$	231	COP	1 113 540	0	(4)	(4)	0,00
	04/2023		95	BRL	517	1	0	1	0,00
	05/2023	ZAR	5 296	$	317	9	0	9	0,01
JPM	02/2023	$	22	IDR	341 076	0	0	0	0,00
	03/2023		21		336 476	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	AUD	73	$	50	0	0	0	0,00
	01/2023	€	2 618		2 744	0	(52)	(52)	(0,05)
	01/2023	£	741		903	12	0	12	0,01
	01/2023	$	8	AUD	13	0	0	0	0,00
	01/2023		468	€	443	5	0	5	0,01
	03/2023		13	IDR	204 219	0	0	0	0,00
	05/2023	CNH	194	$	29	1	0	1	0,00
MYI	01/2023	€	5		6	0	0	0	0,00
	01/2023	$	266	AUD	396	3	0	3	0,00
	01/2023		79	ZAR	1 356	0	0	0	0,00
	03/2023		18	IDR	287 736	0	0	0	0,00
RBC	01/2023		3	AUD	5	0	0	0	0,00
	02/2023		183	NOK	1 824	3	0	3	0,00
	03/2023		20	MXN	404	0	0	0	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
SCX	01/2023	$	18	AUD	27	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	02/2023		23	IDR	358 886	0	0	0	0,00
	04/2023	ZAR	2 860	$	155	0	(11)	(11)	(0,01)
UAG	01/2023		2 301		128	0	(7)	(7)	(0,01)
	02/2023	$	34	IDR	532 647	1	0	1	0,00
	09/2023	ZAR	3 978	$	227	0	(2)	(2)	0,00
						$ 130	$ (173)	$ (43)	(0,04)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	5 950	CHF	5 629	$ 138	$ 0	$ 138	0,14
CBK	01/2023		10 205		9 643	224	0	224	0,23
MYI	01/2023		172		160	1	0	1	0,00
						$ 363	$ 0	$ 363	0,37

Au 31 décembre 2022, les contrats de change suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de Capitalisation et E en EUR (couverte) de Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	€	1 307	$	1 381	$ 0	$ (14)	$ (14)	(0,01)
BOA	01/2023		1 288		1 358	0	(17)	(17)	(0,02)
CBK	01/2023		3		3	0	0	0	0,00
	01/2023	$	10 432	€	10 055	305	0	305	0,31
MBC	01/2023	€	2 365	$	2 487	0	(39)	(39)	(0,04)
	01/2023	$	10 566	€	10 077	193	0	193	0,20
SCX	01/2023		10 221		9 820	264	0	264	0,27
						$ 762	$ (70)	$ 692	0,71

Total des instruments financiers dérivés hors cote	**$ 446**	**0,46**
Total des investissements	**$ 97 180**	**100,03**
Autres actifs et passifs courants	**$ (27)**	**(0,03)**
Actifs nets	**$ 97 153**	**100,00**

ANNEXES À L'ÉTAT DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est une obligation Interest Only (« IO ») ou une obligation zéro-coupon (IO Strip).

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(d) Titres à coupon zéro.

(e) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

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

(g) Affilié au Fonds.

(h) Titre convertible conditionnel.

(i) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : néant) :

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Citigroup, Inc. 3,785 % échéance 17/03/2033	16/08/2022	$ 847	$ 772	0,79
Citigroup, Inc. 6,270 % échéance 17/11/2033	09/11/2022	900	931	0,96
Constellation Oil Services Holding S.A. « B »	10/06/2022	63	63	0,06
Intelsat Emergence S.A.	12/11/2019	750	180	0,18
		$ 2 560	$ 1 946	1,99

Un montant en numéraire de 1 243 $ (31 décembre 2021 : 1 796 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre : 261 $) et un montant en numéraire de 290 $ (31 décembre 2021 : 10 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

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

Mesures de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 8	$ 79 539	$ 648	$ 80 195
Fonds d'investissement	9 253	396	0	9 649
Contrats de mise en pension	0	6 910	0	6 910
Instruments financiers dérivés[3]	33	393	0	426
Totaux	**$ 9 294**	**$ 87 238**	**$ 648**	**$ 97 180**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 5	$ 122 049	$ 1 418	$ 123 472
Fonds d'investissement	13 600	0	0	13 600
Contrats de mise en pension	0	1 827	0	1 827
Instruments financiers dérivés[3]	12	(18)	0	(6)
Totaux	**$ 13 617**	**$ 123 858**	**$ 1 418**	**$ 138 893**

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

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

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

Garantie (reçue)/nantie d'instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ (14)	$ 0	$ (14)	$ S/O	$ S/O	$ S/O
BOA	(104)	0	(104)	(38)	0	(38)
BPS	(290)	290	0	(86)	0	(86)
BRC	5	0	5	5	0	5
CBK	555	(550)	5	(93)	0	(93)
DUB	4	(40)	(36)	(2)	0	(2)
FBF	S/O	S/O	S/O	12	0	12
GLM	(23)	0	(23)	(11)	261	250
GSC	S/O	S/O	S/O	(1)	0	(1)
GST	9	0	9	17	0	17
HUS	S/O	S/O	S/O	(19)	0	(19)
JPM	(63)	0	(63)	21	0	21
MBC	120	0	120	S/O	S/O	S/O
MYC	(5)	0	(5)	(3)	0	(3)
MYI	4	0	4	51	10	61
RBC	3	0	3	159	0	159
SAL	S/O	S/O	S/O	(1)	0	(1)
SCX	253	0	253	134	0	134
SSB	S/O	S/O	S/O	5	0	5
TOR	S/O	S/O	S/O	184	0	184
UAG	(8)	0	(8)	104	0	104

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

Informations comparatives

Ce qui suit est une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières négociables admises à la cote sur une Bourse officielle	40,41	27,56
Valeurs mobilières négociables négociées sur un autre marché réglementé	40,99	57,54
Autres valeurs mobilières négociables	1,15	3,29
Fonds d'investissement	9,93	9,73
Contrats de mise en pension	7,11	1,31
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,41	(0,02)
Instruments financiers dérivés compensés	(0,43)	(0,30)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,46	0,31

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Argentine	0,24	0,21
Australie	0,90	0,82
Autriche	S/O	0,08
Bermudes	S/O	0,91
Brésil	0,41	0,94
Canada	0,94	0,62
Îles Caïmans	0,64	3,02
Chine	0,02	0,07
France	1,06	0,65
Guernesey, Îles anglo-normandes	S/O	0,51
Hong Kong	S/O	0,14
Italie	0,34	0,73
Japon	0,80	S/O
Jersey, Îles anglo-normandes	S/O	0,39
Libéria	S/O	0,46
Luxembourg	1,17	1,47
Mexique	S/O	0,15
Multinational	1,02	0,61
Pays-Bas	0,95	1,66
Norvège	S/O	0,08
Panama	S/O	0,87
Pérou	0,74	0,86
Qatar	0,40	0,32
Singapour	S/O	0,08
Afrique du Sud	1,71	S/O
Espagne	0,37	0,29
Suisse	1,08	S/O
Royaume-Uni	3,36	3,47
États-Unis	65,91	48,78
Îles Vierges britanniques	0,23	0,37
Instruments à court terme	0,26	19,83
Fonds d'investissement	9,93	9,73
Contrats de mise en pension	7,11	1,31
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,41	(0,02)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — achat de protection	0,08	0,01
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	0,04	0,04
Swaps de défaillance de crédit sur indices de crédit — achat de protection	S/O	(0,03)
Swaps de défaillance de crédit sur indices de crédit — vente de protection	S/O	0,02
Swaps de taux d'intérêt	(0,55)	(0,34)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	S/O	0,01
Swaptions de taux d'intérêt	0,63	0,13
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	(0,02)
Swaptions de taux d'intérêt	(1,06)	(0,20)
Options sur titres	(0,01)	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — achat de protection	(0,01)	(0,02)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	0,00	0,01
Swaps de défaillance de crédit sur indices de crédit — vente de protection	0,03	0,04
Swaps de rendement total sur indices	(0,16)	S/O
Contrats de change à terme	(0,04)	(0,14)
Contrats de change à terme couverts	1,08	0,50
Autres actifs et passifs courants	(0,03)	0,58
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES NÉGOCIABLES				
ALBANIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement albanais				
3,500 % éch. 16/06/2027	€	16 800	$ 16 069	0,18
ARGENTINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement argentin				
1,500 % éch. 09/07/2035	$	26 928	6 853	0,08
3,500 % éch. 09/07/2041		133 299	38 224	0,44
Total Argentine			45 077	0,52
AUSTRALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
CIMIC Finance Ltd.				
1,500 % éch. 28/05/2029	€	100	80	0,00
Pacific National Finance Pty. Ltd.				
4,750 % éch. 22/03/2028	$	1 000	888	0,01
Santos Finance Ltd.				
3,649 % éch. 29/04/2031		3 200	2 547	0,03
Woodside Finance Ltd.				
3,700 % éch. 15/09/2026		600	562	0,01
4,500 % éch. 04/03/2029		2 200	2 067	0,02
Total Australie			6 144	0,07
BÉLARUS				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de Biélorussie				
5,875 % éch. 24/02/2026 ^		6 700	2 881	0,03
BERMUDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Aircastle Ltd.				
2,850 % éch. 26/01/2028		9 900	8 112	0,09
4,250 % éch. 15/06/2026		1 600	1 507	0,02
5,250 % éch. 11/08/2025		32 800	31 576	0,36
Bacardi Ltd.				
4,700 % éch. 15/05/2028		22 840	21 849	0,25
Total Bermudes			63 044	0,72
BRÉSIL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				
0,000 % éch. 30/01/2023 (c)(e)		13 194	32	0,00
CANADA				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Air Canada Pass-Through Trust				
3,300 % éch. 15/07/2031		795	681	0,01
4,125 % éch. 15/11/2026		1 142	1 045	0,01
5,250 % éch. 01/10/2030		3 369	3 188	0,04
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
2,750 % éch. 29/03/2028	€	21 850	20 408	0,23
4,850 % éch. 17/04/2028	$	200	189	0,00
Total Canada			25 511	0,29
ÎLES CAÏMANS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				
5,229 % éch. 16/01/2030		1 714	1 696	0,02
Catamaran CLO Ltd.				
5,425 % éch. 22/04/2030		4 477	4 413	0,05
OZLM Ltd.				
5,674 % éch. 16/05/2030		5 226	5 147	0,06
Venture CLO Ltd.				
5,343 % éch. 20/01/2029		5 895	5 827	0,07
5,596 % éch. 07/09/2030		8 000	7 854	0,09
Vibrant CLO Ltd.				
5,283 % éch. 15/09/2030		2 092	2 058	0,02
			26 995	0,31
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % éch. 18/11/2027	$	12 810	$ 10 258	0,12
2,875 % éch. 15/02/2025		9 400	8 691	0,10
3,250 % éch. 15/02/2027		4 900	4 200	0,05
4,250 % éch. 15/04/2026		3 600	3 268	0,04
5,250 % éch. 15/05/2024		1 200	1 177	0,01
5,500 % éch. 15/01/2026		10 500	9 994	0,11
Kaisa Group Holdings Ltd.				
9,375 % éch. 30/06/2024 ^		9 850	1 384	0,02
9,750 % éch. 28/09/2023 ^		22 900	3 223	0,04
10,500 % éch. 15/01/2025 ^		21 600	3 040	0,03
10,875 % éch. 23/07/2023 ^		5 800	816	0,01
11,250 % éch. 16/04/2025 ^		17 000	2 393	0,03
11,500 % éch. 30/01/2023 ^		900	127	0,00
11,650 % éch. 01/06/2026 ^		9 300	1 309	0,02
11,700 % éch. 11/11/2025 ^		5 750	809	0,01
11,950 % éch. 12/11/2023 ^		4 400	619	0,01
KWG Group Holdings Ltd.				
5,875 % éch. 10/11/2024		400	174	0,00
Lima Metro Line Finance Ltd.				
5,875 % éch. 05/07/2034		2 791	2 716	0,03
Melco Resorts Finance Ltd.				
4,875 % éch. 06/06/2025		3 400	3 128	0,04
5,375 % éch. 04/12/2029		8 900	7 156	0,08
5,750 % éch. 21/07/2028		1 000	838	0,01
MGM China Holdings Ltd.				
4,750 % éch. 01/02/2027		400	354	0,00
5,250 % éch. 18/06/2025		200	188	0,00
New Metro Global Ltd.				
4,500 % éch. 02/05/2026		1 200	816	0,01
Noble Finance Co. (11,000 % en numéraire ou 15,000 % de rémunération en nature)				
11,000 % éch. 15/02/2028 (a)		507	564	0,01
Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % en espèces et 1,000 % en PIK)				
7,350 % éch. 01/12/2026 ^(a)		28 746	15 882	0,18
Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. (6,720 % en numéraire et 1,000 % en PIK)				
7,720 % éch. 01/12/2026 ^(a)		534	143	0,00
Park Aerospace Holdings Ltd.				
4,500 % éch. 15/03/2023		22 500	22 446	0,26
5,500 % éch. 15/02/2024		504	498	0,01
Sands China Ltd.				
3,350 % éch. 08/03/2029		500	409	0,00
Seagate HDD Cayman				
4,125 % éch. 15/01/2031		5 918	4 628	0,05
9,625 % éch. 01/12/2032		8 386	9 209	0,11
Seazen Group Ltd.				
4,450 % éch. 13/07/2025		12 500	8 810	0,10
Sunac China Holdings Ltd.				
5,950 % éch. 26/04/2024 ^		19 200	4 205	0,05
6,500 % éch. 09/07/2023 ^		4 800	1 065	0,01
6,500 % éch. 26/01/2026 ^		300	62	0,00
6,650 % éch. 03/08/2024 ^		5 900	1 282	0,01
7,000 % éch. 09/07/2025 ^		7 400	1 618	0,02
7,250 % éch. 14/06/2022 ^		30 400	6 384	0,07
7,500 % éch. 01/02/2024 ^		5 500	1 221	0,01
7,950 % éch. 11/10/2023 ^		11 800	2 589	0,03
8,350 % éch. 19/04/2023 ^		1 100	243	0,00
Trafford Centre Finance Ltd.				
3,888 % éch. 28/07/2038	£	3 700	3 890	0,04
Wynn Macau Ltd.				
4,875 % éch. 01/10/2024	$	300	284	0,00
5,500 % éch. 15/01/2026		7 600	6 984	0,08
5,625 % éch. 26/08/2028		1 700	1 456	0,02
			160 550	1,83
Total Îles Caïmans			187 545	2,14
CHILI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.				
3,650 % éch. 07/05/2030		3 800	3 459	0,04
GNL Quintero S.A.				
4,634 % éch. 31/07/2029		3 459	3 346	0,04
Total Chili			6 805	0,08
CHINE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Yango Justice International Ltd.				
7,500 % éch. 15/04/2024 ^	$	28 200	$ 1 029	0,01
7,500 % éch. 17/02/2025 ^		19 100	697	0,01
7,875 % éch. 04/09/2024 ^		19 800	723	0,01
Total Chine			2 449	0,03
COLOMBIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Ecopetrol S.A.				
5,875 % éch. 28/05/2045		200	140	0,00
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement colombien				
5,000 % éch. 15/06/2045		49 920	34 148	0,39
5,625 % éch. 26/02/2044		3 100	2 289	0,03
			36 437	0,42
Total Colombie			36 577	0,42
CHYPRE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Atrium Finance PLC				
2,625 % éch. 05/09/2027	€	19 800	14 814	0,17
DANEMARK				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
TDC Net A/S				
5,056 % éch. 31/05/2028		12 000	12 615	0,14
RÉPUBLIQUE DOMINICAINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de République Dominicaine				
6,500 % éch. 15/02/2048	$	40 600	33 597	0,38
ÉQUATEUR				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement d'Équateur				
0,000 % éch. 31/07/2030 (c)		20 689	8 120	0,09
1,500 % éch. 31/07/2040		13 450	5 516	0,06
5,500 % éch. 31/07/2030		12 800	8 217	0,10
Total Équateur			21 853	0,25
ÉGYPTE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement égyptien				
5,625 % éch. 16/04/2030	€	2 550	1 898	0,02
6,375 % éch. 11/04/2031		17 600	13 106	0,15
7,500 % éch. 16/02/2061	$	44 000	27 319	0,31
8,500 % éch. 31/01/2047		9 500	6 362	0,08
Total Égypte			48 685	0,56
FINLANDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Balder Finland Oyj				
1,000 % éch. 18/01/2027	€	200	160	0,00
1,000 % éch. 20/01/2029		300	214	0,00
1,375 % éch. 24/05/2030		4 900	3 335	0,04
2,000 % éch. 18/01/2031		300	206	0,00
SBB Treasury Oyj				
0,750 % éch. 14/12/2028		4 700	3 235	0,04
Total Finlande			7 150	0,08
FRANCE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Accor S.A.				
2,375 % éch. 29/11/2028		1 100	1 007	0,01
Altarea S.C.A.				
1,750 % éch. 16/01/2030		500	398	0,00
1,875 % éch. 17/01/2028		600	498	0,01
Altareit S.C.A.				
2,875 % éch. 02/07/2025		100	95	0,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Altice France S.A.			
2,125 % éch. 15/02/2025	€ 2 200	$ 2 084	0,02
3,375 % éch. 15/01/2028	3 100	2 504	0,03
4,000 % éch. 15/07/2029 (i)	10 900	8 834	0,10
4,250 % éch. 15/10/2029	20 100	16 173	0,19
BNP Paribas S.A.			
1,904 % éch. 30/09/2028	$ 35 700	29 782	0,34
3,500 % éch. 16/11/2027	1 400	1 289	0,02
4,400 % éch. 14/08/2028	2 200	2 084	0,02
4,705 % éch. 10/01/2025	14 400	14 262	0,16
5,198 % éch. 10/01/2030	4 000	3 809	0,04
CGG S.A.			
8,750 % éch. 01/04/2027	8 200	6 568	0,08
Crédit Agricole S.A.			
1,907 % éch. 16/06/2026	13 350	12 181	0,14
Électricité de France S.A.			
4,500 % éch. 21/09/2028	5 700	5 406	0,06
La Mondiale SAM			
5,050 % éch. 17/12/2025 (e)	€ 12 665	13 414	0,15
Loxam S.A.S.			
2,875 % éch. 15/04/2026	1 600	1 525	0,02
3,750 % éch. 15/07/2026	1 900	1 837	0,02
4,500 % éch. 15/02/2027	5 500	5 388	0,06
New Immo Holding S.A.			
2,750 % éch. 26/11/2026	200	182	0,00
Renault S.A.			
1,250 % éch. 24/06/2025	12 000	11 506	0,13
2,375 % éch. 25/05/2026	46 800	45 075	0,52
Société Générale S.A.			
4,000 % éch. 12/01/2027	$ 700	649	0,01
7,375 % éch. 04/10/2023 (e)(g)	400	384	0,00
7,875 % éch. 18/12/2023 (e)(g)	2 600	2 580	0,03
TDF Infrastructure SASU			
1,750 % éch. 01/12/2029	€ 52 000	42 243	0,48
Ubisoft Entertainment S.A.			
0,878 % éch. 24/11/2027	6 000	4 969	0,06
Verallia S.A.			
1,875 % éch. 10/11/2031	19 500	16 287	0,19
		253 013	2,89
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			
Altice France S.A.			
4,378 % éch. 02/02/2026	3 087	3 134	0,04
Casino Guichard-Perrachon S.A.			
5,340 % éch. 31/08/2025	22 500	20 432	0,23
		23 566	0,27
Total France		276 579	3,16
ALLEMAGNE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
ADLER Real Estate AG			
2,125 % éch. 06/02/2024	1 400	1 326	0,01
3,000 % éch. 27/04/2026	3 500	2 610	0,03
Deutsche Bank AG			
1,375 % éch. 17/02/2032	18 100	14 100	0,16
1,625 % éch. 20/01/2027	27 500	25 922	0,30
1,750 % éch. 19/11/2030	15 700	13 197	0,15
3,035 % éch. 28/05/2032 (h)	$ 1 100	836	0,01
3,547 % éch. 18/09/2031	19 350	15 555	0,18
3,729 % éch. 14/01/2032 (h)	2 900	2 132	0,02
3,742 % éch. 07/01/2033	1 900	1 353	0,02
3,961 % éch. 26/11/2025	10 300	9 850	0,11
5,625 % éch. 19/05/2031	€ 5 500	5 740	0,07
5,882 % éch. 08/07/2031	$ 37 300	32 279	0,37
DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH			
2,500 % éch. 25/01/2027	€ 1 200	960	0,01
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide			
1,625 % éch. 09/07/2024	17 200	17 773	0,20
1,875 % éch. 31/03/2028	19 200	17 697	0,20
2,125 % éch. 09/07/2027	1 600	1 533	0,02
IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % en numéraire ou 4,375 % en PIK)			
3,625 % éch. 15/05/2025 (a)	6 600	6 445	0,07
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % en numéraire ou 4,500 % en PIK)			
3,750 % éch. 15/09/2026 (a)	23 400	21 783	0,25
INEOS Styrolution Group GmbH			
2,250 % éch. 16/01/2027 (i)	19 000	16 562	0,19
Volkswagen Bank GmbH			
2,500 % éch. 31/07/2026	€ 15 800	$ 15 756	0,18
ZF Finance GmbH			
2,750 % éch. 25/05/2027	16 200	14 610	0,17
3,750 % éch. 21/09/2028	50 400	45 367	0,52
Total Allemagne		283 386	3,24
GHANA			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement du Ghana			
8,125 % éch. 26/03/2032 ^	$ 4 200	1 541	0,02
8,750 % éch. 11/03/2061 ^	5 100	1 807	0,02
8,950 % éch. 26/03/2051 ^	5 600	2 011	0,02
Total Ghana		5 359	0,06
GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust			
5,250 % éch. 30/05/2025	146	145	0,00
Globalworth Real Estate Investments Ltd.			
2,950 % éch. 29/07/2026	€ 7 400	6 291	0,07
3,000 % éch. 29/03/2025	43 439	40 686	0,47
Sirius Real Estate Ltd.			
1,125 % éch. 22/06/2026	200	167	0,00
1,750 % éch. 24/11/2028	500	367	0,00
Total Guernesey, Îles anglo-normandes		47 656	0,54
HONG KONG			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Fortune Star BVI Ltd.			
3,950 % éch. 02/10/2026	57 200	35 097	0,40
Huarong Finance Co. Ltd.			
2,125 % éch. 30/09/2023	$ 41 200	39 655	0,45
5,824 % éch. 24/02/2023	11 100	11 065	0,13
Total Hong Kong		85 817	0,98
INDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Adani Electricity Mumbai Ltd.			
3,949 % éch. 12/02/2030	2 300	1 762	0,02
INDONÉSIE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
LLPL Capital Pte. Ltd.			
6,875 % éch. 04/02/2039	171	151	0,00
Pertamina Persero PT			
6,500 % éch. 07/11/2048	33 400	33 570	0,38
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara			
3,000 % éch. 30/06/2030	17 600	14 468	0,17
		48 189	0,55
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement indonésien			
1,400 % éch. 30/10/2031	€ 4 630	3 867	0,05
Total Indonésie		52 056	0,60
IRLANDE			
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS			
Accunia European CLO DAC			
2,308 % éch. 15/10/2030	1 016	1 066	0,01
Adagio CLO DAC			
2,098 % éch. 15/10/2031	5 800	6 033	0,07
Ares European CLO			
2,038 % éch. 15/10/2030	299	312	0,00
Ares European CLO DAC			
1,988 % éch. 15/04/2030	1 680	1 745	0,02
2,038 % éch. 15/10/2030	1 695	1 765	0,02
2,158 % éch. 15/10/2031	9 900	10 241	0,12
2,306 % éch. 20/04/2032	500	518	0,01
Armada Euro CLO DAC			
2,098 % éch. 15/07/2031	11 100	11 508	0,13
Aurium CLO DAC			
2,108 % éch. 16/01/2031	€ 4 798	$ 5 008	0,06
3,152 % éch. 23/03/2032	10 400	10 863	0,12
Avoca CLO DAC			
2,198 % éch. 15/10/2032	2 900	2 997	0,03
Bain Capital Euro CLO DAC			
2,196 % éch. 20/01/2032	5 500	5 719	0,06
Black Diamond CLO DAC			
2,316 % éch. 20/01/2032	2 411	2 516	0,03
2,778 % éch. 15/05/2032	4 400	4 553	0,05
Blackrock European CLO DAC			
1,998 % éch. 15/10/2031	10 900	11 280	0,13
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC			
1,050 % éch. 15/01/2031	1 000	960	0,01
2,098 % éch. 15/01/2031	7 796	8 094	0,09
BNPP AM Euro CLO DAC			
1,978 % éch. 15/04/2031	1 000	1 035	0,01
Bridgepoint CLO DAC			
2,588 % éch. 15/01/2034	1 300	1 358	0,02
Cairn CLO DAC			
2,158 % éch. 15/10/2031	8 600	8 985	0,10
Carlyle Euro CLO DAC			
2,078 % éch. 15/01/2031	11 595	12 075	0,14
2,428 % éch. 15/08/2030	4 833	5 034	0,06
2,688 % éch. 15/08/2032	4 400	4 562	0,05
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.			
2,548 % éch. 15/11/2031	7 450	7 705	0,09
CVC Cordatus Loan Fund DAC			
2,028 % éch. 15/10/2031	13 200	13 681	0,16
2,138 % éch. 15/04/2032	1 399	1 452	0,02
2,278 % éch. 27/01/2031	1 397	1 462	0,02
2,578 % éch. 15/08/2032	2 400	2 497	0,03
Dryden Euro CLO DAC			
2,038 % éch. 15/04/2033	12 800	13 254	0,15
2,622 % éch. 15/05/2034	14 700	15 248	0,17
Euro-Galaxy CLO DAC			
1,958 % éch. 11/04/2031	1 300	1 354	0,02
2,122 % éch. 24/04/2034	9 600	9 937	0,11
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC			
2,356 % éch. 20/01/2032	1 700	1 755	0,02
Griffith Park CLO DAC			
2,522 % éch. 21/11/2031	31 400	32 442	0,37
Harvest CLO DAC			
1,040 % éch. 15/07/2031	1 600	1 543	0,02
2,136 % éch. 20/10/2031	18 800	19 486	0,22
2,138 % éch. 15/07/2031	10 400	10 719	0,12
2,228 % éch. 15/01/2032	17 600	18 200	0,21
2,775 % éch. 26/06/2030	2 606	2 719	0,03
Invesco Euro CLO DAC			
2,028 % éch. 15/07/2031	850	881	0,01
Jubilee CLO DAC			
1,978 % éch. 15/04/2030	4 200	4 386	0,05
1,988 % éch. 15/04/2030	1 900	1 982	0,02
2,028 % éch. 15/04/2031	5 850	6 007	0,07
Laurelin DAC			
2,176 % éch. 20/10/2031	10 900	11 278	0,13
Madison Park Euro Funding DAC			
2,128 % éch. 15/01/2032	35 500	36 682	0,42
2,178 % éch. 15/07/2032	5 600	5 791	0,07
Man GLG Euro CLO DAC			
2,188 % éch. 15/10/2032	5 197	5 366	0,06
2,736 % éch. 15/12/2031	10 700	11 078	0,13
Oak Hill European Credit Partners DAC			
2,186 % éch. 20/01/2032	2 164	2 254	0,03
2,196 % éch. 20/10/2031	15 200	15 740	0,18
OCP Euro CLO DAC			
2,198 % éch. 15/01/2032	2 964	3 105	0,03
2,382 % éch. 22/09/2034	12 700	13 174	0,15
OZLME DAC			
2,397 % éch. 27/07/2032	2 000	2 087	0,02
Palmer Square European Loan Funding DAC			
2,158 % éch. 15/04/2031	6 145	6 377	0,07
2,428 % éch. 15/10/2031	4 902	5 111	0,06
Palmerston Park CLO DAC			
2,053 % éch. 18/04/2030	1 195	1 253	0,01
Sculptor European CLO DAC			
2,153 % éch. 14/01/2032	6 700	6 959	0,08

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Segovia European CLO DAC				
2,336 % éch. 20/07/2032	€	10 100	$ 10 437	0,12
Tikehau CLO DAC				
2,596 % éch. 04/08/2034		9 400	9 740	0,11
Toro European CLO DAC				
2,239 % éch. 12/01/2032		2 500	2 570	0,03
2,298 % éch. 15/07/2030		422	442	0,01
2,572 % éch. 15/02/2034		7 650	7 875	0,09
			442 256	5,05
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC				
2,700 % éch. 11/06/2023		26 550	1 983	0,02
AerCap Ireland Capital DAC				
3,150 % éch. 15/02/2024	$	12 900	12 476	0,14
3,500 % éch. 15/01/2025		200	191	0,00
3,650 % éch. 21/07/2027		400	362	0,00
4,450 % éch. 01/10/2025		400	385	0,01
4,450 % éch. 03/04/2026		5 350	5 113	0,06
4,625 % éch. 15/10/2027		34 750	32 331	0,37
Bank of Ireland Group PLC				
6,253 % éch. 16/09/2026		10 600	10 522	0,12
SMBC Aviation Capital Finance DAC				
2,300 % éch. 15/06/2028		900	740	0,01
			64 103	0,73
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Setanta Aircraft Leasing DAC				
6,730 % éch. 05/11/2028		48 800	48 653	0,56
Total Irlande			555 012	6,34
ISRAËL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Energean Israel Finance Ltd.				
4,500 % éch. 30/03/2024		9 900	9 576	0,11
ITALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Aeroporti di Roma SpA				
1,750 % éch. 30/07/2031	€	3 400	2 710	0,03
Atlantia SpA				
1,625 % éch. 03/02/2025		7 200	7 195	0,08
1,875 % éch. 13/07/2027		3 000	2 729	0,03
1,875 % éch. 12/02/2028		79 550	70 786	0,81
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
2,625 % éch. 28/04/2025		34 235	33 156	0,38
3,625 % éch. 24/09/2024		16 656	16 918	0,19
8,500 % éch. 10/09/2030		31 780	29 918	0,34
Intesa Sanpaolo SpA				
3,250 % éch. 23/09/2024	$	7 900	7 498	0,09
4,000 % éch. 23/09/2029		10 276	8 813	0,10
4,198 % éch. 01/06/2032		500	368	0,01
5,148 % éch. 10/06/2030	£	6 000	5 898	0,07
Nexi SpA				
2,125 % éch. 30/04/2029	€	40 500	35 188	0,40
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA				
3,500 % éch. 09/10/2025		100	99	0,00
UniCredit SpA				
1,982 % éch. 03/06/2027	$	10 500	8 963	0,10
2,200 % éch. 22/07/2027	€	6 250	6 053	0,07
2,569 % éch. 22/09/2026	$	15 950	14 139	0,16
5,459 % éch. 30/06/2035		400	326	0,01
7,296 % éch. 02/04/2034		14 301	13 133	0,15
7,830 % éch. 04/12/2023		80 550	81 402	0,93
Total Italie			345 292	3,95
CÔTE D'IVOIRE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire				
6,625 % éch. 22/03/2048	€	10 400	7 857	0,09
6,875 % éch. 17/10/2040		3 400	2 746	0,03
Total Côte d'Ivoire			10 603	0,12

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
JAPON				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nissan Motor Co. Ltd.				
3,201 % éch. 17/09/2028	€	7 100	$ 6 661	0,08
4,345 % éch. 17/09/2027	$	76 600	69 577	0,79
4,810 % éch. 17/09/2030		5 100	4 339	0,05
Total Japon			80 577	0,92
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AA Bond Co. Ltd.				
4,875 % éch. 31/07/2043	£	6 943	7 916	0,09
5,500 % éch. 31/07/2050		21 190	22 112	0,25
7,375 % éch. 31/07/2050		7 300	7 594	0,09
Adient Global Holdings Ltd.				
3,500 % éch. 15/08/2024	€	4 600	4 724	0,05
Corsair International Ltd.				
5,473 % éch. 28/01/2027		18 800	19 914	0,23
5,823 % éch. 28/01/2029		8 200	8 664	0,10
G City Europe Ltd.				
4,250 % éch. 11/09/2025		19 820	17 767	0,20
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.				
3,250 % éch. 12/11/2025		900	755	0,01
Total Jersey, Îles anglo-normandes			89 446	1,02
		ACTIONS		
LUXEMBOURG				
ACTIONS ORDINAIRES				
Intelsat Emergence S.A. (b)(h)		184 122	4 419	0,05
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES				
Corestate Capital Holding S.A.				
1,375 % éch. 28/11/2049 ^	€	14 700	2 922	0,04
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Albion Financing SARL				
5,250 % éch. 15/10/2026		15 600	14 608	0,17
6,125 % éch. 15/10/2026	$	5 500	4 913	0,06
Altice Financing S.A.				
3,000 % éch. 15/01/2028	€	7 900	6 684	0,08
5,750 % éch. 15/08/2029	$	64 700	51 012	0,58
Altice France Holding S.A.				
6,000 % éch. 15/02/2028		23 300	13 804	0,16
Aroundtown S.A.				
5,375 % éch. 21/03/2029		17 900	13 569	0,15
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature)				
3,000 % éch. 31/12/2026 (a)		752	445	0,01
Corestate Capital Holding S.A.				
3,500 % éch. 15/04/2023 ^	€	33 100	5 530	0,06
CPI Property Group S.A.				
1,500 % éch. 27/01/2031		8 900	5 513	0,06
1,625 % éch. 23/04/2027		9 000	6 862	0,08
1,750 % éch. 14/01/2030		10 300	6 707	0,08
2,750 % éch. 12/05/2026		20 750	17 441	0,20
2,750 % éch. 22/01/2028	£	3 200	2 578	0,03
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % éch. 19/11/2025	€	600	518	0,01
FEL Energy SARL				
5,750 % éch. 01/12/2040	$	45 828	39 284	0,45
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.				
4,250 % éch. 06/04/2024	£	15 900	13 394	0,15
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
6,500 % éch. 15/03/2030	$	13 710	12 291	0,14
Lincoln Financing SARL				
3,625 % éch. 01/04/2024	€	66 575	70 359	0,80
6,007 % éch. 01/04/2024		1 475	1 568	0,02
Logicor Financing SARL				
0,750 % éch. 15/07/2024		1 100	1 079	0,01
3,250 % éch. 13/11/2028		13 900	12 516	0,14
Petrorio Luxembourg Trading SARL				
6,125 % éch. 09/06/2026	$	3 700	3 526	0,04

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
5,125 % éch. 29/10/2022 ^	$	3 900	$ 456	0,01
Summer BC Holdco SARL				
5,750 % éch. 31/10/2026	€	17 700	16 175	0,18
			320 832	3,67
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Albion Financing SARL				
6,752 % éch. 17/08/2026		6 946	7 273	0,08
Connect Finco SARL				
7,890 % éch. 11/12/2026	$	3 180	3 149	0,04
Delos Finance SARL				
6,480 % éch. 06/10/2023		420	420	0,00
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
7,445 % éch. 01/02/2029		3 567	3 451	0,04
			14 293	0,16
		ACTIONS		
DROITS				
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05/12/2025		38 562	275	0,00
Total Luxembourg			342 741	3,92
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
MACÉDOINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de Macédoine du nord				
2,750 % éch. 18/01/2025	€	1 600	1 599	0,02
3,675 % éch. 03/06/2026		5 200	5 147	0,06
Total Macédoine			6 746	0,08
ÎLE MAURICE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Greenko Solar Mauritius Ltd.				
5,550 % éch. 29/01/2025	$	7 700	7 267	0,08
		ACTIONS		
MEXIQUE				
ACTIONS ORDINAIRES				
Hipotecaria Su Casita S.A. (b)		28 925	0	0,00
Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V. (b)		477	0	0,00
Total Actions ordinaires			0	0,00
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Petroleos Mexicanos				
5,625 % éch. 23/01/2046	$	11 142	6 506	0,07
6,350 % éch. 12/02/2048		3 800	2 332	0,03
6,500 % éch. 02/06/2041		5 600	3 658	0,04
6,625 % éch. 15/06/2035		76 800	55 894	0,64
6,625 % éch. 15/06/2038		3 900	2 690	0,03
6,700 % éch. 16/02/2032		79 587	62 651	0,72
6,750 % éch. 21/09/2047		20 900	13 382	0,15
7,690 % éch. 23/01/2050		13 400	9 302	0,11
			156 415	1,79
Total Mexique			156 415	1,79
MULTINATIONAL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Allied Universal Holdco LLC				
3,625 % éch. 01/06/2028	€	18 800	15 992	0,19
Connect Finco SARL				
6,750 % éch. 01/10/2026	$	13 400	12 446	0,14
Total Multinational			28 438	0,33
PAYS-BAS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
ASR Nederland NV				
7,000 % éch. 07/12/2043	€	1 400	1 500	0,02
Athora Netherlands NV				
7,000 % éch. 19/06/2025 (e)(g)		4 300	4 492	0,05

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Citycon Treasury BV				
1,625 % éch. 12/03/2028	€	3 400	$ 2 656	0,03
CTP NV				
0,500 % éch. 21/06/2025		1 200	1 075	0,01
1,250 % éch. 21/06/2029		200	142	0,00
1,500 % éch. 27/09/2031		1 500	962	0,01
Imperial Brands Finance Netherlands BV				
1,750 % éch. 18/03/2033		28 800	21 726	0,25
ING Groep NV				
5,750 % éch. 16/11/2026 (e)(g)	$	9 000	7 994	0,09
6,500 % éch. 16/04/2025 (e)(g)		18 702	17 726	0,20
6,750 % éch. 16/04/2024 (e)(g)		14 280	13 770	0,16
NE Property BV				
3,375 % éch. 14/07/2027	€	25 250	23 385	0,27
NN Group NV				
4,500 % éch. 15/01/2026 (e)		17 900	18 631	0,21
Q-Park Holding BV				
2,000 % éch. 01/03/2027		400	358	0,00
3,500 % éch. 01/02/2025		33 350	32 293	0,37
Syngenta Finance NV				
3,375 % éch. 16/04/2026		20 000	20 180	0,23
4,892 % éch. 24/04/2025	$	32 895	31 888	0,37
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV				
4,375 % éch. 09/05/2030	€	11 500	10 182	0,12
4,500 % éch. 01/03/2025		10 600	10 880	0,13
United Group BV				
3,625 % éch. 15/02/2028		1 600	1 242	0,01
4,875 % éch. 01/07/2024		230	229	0,00
5,250 % éch. 01/02/2030		8 600	6 647	0,08
Volkswagen International Finance NV				
3,500 % éch. 17/06/2025 (e)		10 100	10 002	0,11
			237 960	2,72
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Sigma Bidco BV				
3,738 % éch. 02/07/2025		9 500	8 833	0,10
WP/AP Telecom Holdings BV				
6,202 % éch. 30/03/2029		66 400	68 311	0,78
Ziggo BV				
3,764 % éch. 31/01/2029		19 560	19 331	0,22
			96 475	1,10
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES				
EMF-NL BV				
2,178 % éch. 17/04/2041		25	26	0,00
Eurosail BV				
2,878 % éch. 17/10/2040		151	160	0,00
			186	0,00
Total Pays-Bas			334 621	3,82
NIGERIA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement nigérian				
7,143 % éch. 23/02/2030	$	8 200	6 309	0,07
7,625 % éch. 28/11/2047		17 700	11 463	0,13
7,875 % éch. 16/02/2032		23 600	17 866	0,21
Total Nigeria			35 638	0,41
OMAN				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement omanais				
6,750 % éch. 17/01/2048		29 300	27 543	0,31
PANAMA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement panaméen				
6,700 % éch. 26/01/2036		20 600	21 544	0,25
PORTUGAL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Espirito Santo S.A.				
4,750 % éch. 15/01/2018 ^	€	200	31	0,00
Galp Energia SGPS S.A.				
2,000 % éch. 15/01/2026	€	12 300	$ 12 090	0,14
Total Portugal			12 121	0,14
QATAR				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nakilat, Inc.				
6,067 % éch. 31/12/2033	$	10 259	10 600	0,12
ROUMANIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement roumain				
2,000 % éch. 14/04/2033	€	1 500	1 030	0,01
2,875 % éch. 13/04/2042		8 000	4 802	0,06
Total Roumanie			5 832	0,07
RUSSIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
ALROSA Finance S.A.				
3,100 % éch. 25/06/2027 ^	$	22 400	3 374	0,04
4,650 % éch. 09/04/2024 ^		3 200	444	0,01
MMK International Capital DAC				
4,375 % éch. 13/06/2024 ^		8 600	3 010	0,03
			6 828	0,08
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement russe				
2,875 % éch. 04/12/2025 ^	€	7 700	2 383	0,03
4,250 % éch. 23/06/2027 ^	$	13 800	4 830	0,05
4,750 % éch. 27/05/2026 ^		200	70	0,00
5,250 % éch. 23/06/2047 ^		31 200	11 544	0,13
			18 827	0,21
Total Russie			25 655	0,29
SERBIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement serbe				
1,650 % éch. 03/03/2033	€	8 900	5 794	0,07
SINGAPOUR				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Flex Ltd.				
3,750 % éch. 01/02/2026	$	14 000	13 236	0,15
SLOVÉNIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % éch. 27/01/2025	€	8 300	8 036	0,09
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % éch. 05/02/2030		7 100	6 288	0,07
Total Slovénie			14 324	0,16
AFRIQUE DU SUD				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AngloGold Ashanti Holdings PLC				
3,750 % éch. 01/10/2030	$	2 000	1 736	0,02
Growthpoint Properties International Pty. Ltd.				
5,872 % éch. 02/05/2023		2 000	1 993	0,02
Sasol Financing USA LLC				
5,875 % éch. 27/03/2024		4 100	4 021	0,05
Total Afrique du Sud			7 750	0,09
ESPAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.				
1,375 % éch. 17/06/2025 (i)	€	8 200	8 080	0,09
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
5,875 % éch. 24/09/2023 (e)(g)		2 000	2 057	0,03
6,000 % éch. 29/03/2024 (e)(g)		2 800	2 915	0,03
6,000 % éch. 15/01/2026 (e)(g)		9 200	9 383	0,11
6,138 % éch. 14/09/2028	$	15 800	15 846	0,18
Banco de Sabadell S.A.				
5,375 % éch. 08/09/2026	€	22 100	23 473	0,27
Banco Santander S.A.				
3,490 % éch. 28/05/2030	$	1 400	$ 1 181	0,01
Cellnex Finance Co. S.A.				
2,000 % éch. 15/09/2032	€	23 800	18 933	0,22
Lorca Telecom Bondco S.A.				
4,000 % éch. 18/09/2027		1 900	1 823	0,02
			83 691	0,96
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Grifols S.A.				
3,708 % éch. 15/11/2027		1 296	1 340	0,01
Total Espagne			85 031	0,97
SRI LANKA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement du Sri Lanka				
7,550 % éch. 28/03/2030 ^	$	16 800	5 361	0,06
7,850 % éch. 14/03/2029 ^		5 800	1 857	0,02
Total Sri Lanka			7 218	0,08
SUÈDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Castellum AB				
0,750 % éch. 04/09/2026	€	200	166	0,00
Sagax AB				
2,000 % éch. 17/01/2024		500	512	0,01
2,250 % éch. 13/03/2025		400	394	0,00
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB				
1,750 % éch. 14/01/2025		1 600	1 466	0,02
Volvo Car AB				
4,250 % éch. 31/05/2028		29 900	29 411	0,34
Total Suède			31 949	0,37
SUISSE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Credit Suisse AG				
6,500 % éch. 08/08/2023 (g)	$	57 800	56 107	0,64
Credit Suisse Group AG				
3,869 % éch. 12/01/2029		300	241	0,00
4,194 % éch. 01/04/2031		1 400	1 090	0,01
6,375 % éch. 21/08/2026 (e)(g)		4 200	3 021	0,04
6,442 % éch. 11/08/2028		3 200	2 919	0,03
6,537 % éch. 12/08/2033		500	440	0,01
7,250 % éch. 12/09/2025 (e)(g)		400	288	0,00
7,500 % éch. 17/07/2023 (e)(g)		5 800	4 649	0,05
UBS AG				
5,125 % éch. 15/05/2024 (g)		22 800	22 552	0,26
UBS Group AG				
4,125 % éch. 15/04/2026		15 100	14 502	0,17
4,703 % éch. 05/08/2027		1 200	1 161	0,01
Total Suisse			106 970	1,22
TURQUIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement turc				
4,875 % éch. 16/04/2043		33 067	21 612	0,25
5,750 % éch. 11/05/2047		58 300	39 936	0,45
Total Turquie			61 548	0,70
UKRAINE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
NPC Ukrenergo				
6,875 % éch. 09/11/2028 ^		1 000	178	0,00
State Agency of Roads of Ukraine				
6,250 % éch. 24/06/2030 ^		200	36	0,00
			214	0,00
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
State Agency of Roads of Ukraine				
6,250 % éch. 24/06/2030		1 200	213	0,00
Obligation internationale du gouvernement ukrainien				
4,375 % éch. 27/01/2032	€	67 619	13 441	0,15
6,750 % éch. 20/06/2028 ^		6 300	1 248	0,02

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
6,876 % éch. 21/05/2031 ^	$	6 400	$ 1 282	0,02
7,375 % éch. 25/09/2034 ^		5 300	1 021	0,01
8,994 % éch. 01/02/2026 ^		8 200	1 857	0,02
			19 062	0,22
Total Ukraine			19 276	0,22
ÉMIRATS ARABES UNIS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
DAE Sukuk Difc Ltd.				
3,750 % éch. 15/02/2026		11 800	11 223	0,13
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Barclays PLC				
0,577 % éch. 09/08/2029	€	2 500	2 112	0,02
6,125 % éch. 15/12/2025 (e)(g)	$	11 100	10 143	0,12
7,250 % éch. 15/03/2023 (e)(g)	£	9 300	11 086	0,13
7,437 % éch. 02/11/2033	$	8 500	8 932	0,10
7,750 % éch. 15/09/2023 (e)(g)		3 500	3 426	0,04
BAT International Finance PLC				
3,950 % éch. 15/06/2025		1 600	1 538	0,02
Bellis Acquisition Co. PLC				
3,250 % éch. 16/02/2026	£	55 800	54 864	0,63
FCE Bank PLC				
1,615 % éch. 11/05/2023	€	300	317	0,00
Greene King Finance PLC				
5,106 % éch. 15/03/2034	£	368	390	0,00
HSBC Holdings PLC				
1,645 % éch. 18/04/2026	$	4 800	4 336	0,05
2,099 % éch. 04/06/2026		3 200	2 915	0,03
2,848 % éch. 04/06/2031		4 200	3 361	0,04
3,900 % éch. 25/05/2026		20 900	19 931	0,23
3,973 % éch. 22/05/2030		9 300	8 159	0,09
4,300 % éch. 08/03/2026		26 700	25 857	0,30
4,950 % éch. 31/03/2030		2 500	2 390	0,03
INEOS Finance PLC				
2,875 % éch. 01/05/2026	€	1 650	1 523	0,02
Informa PLC				
1,250 % éch. 22/04/2028		7 500	6 803	0,08
Jaguar Land Rover Automotive PLC				
5,875 % éch. 15/11/2024		10 800	10 909	0,12
John Lewis PLC				
4,250 % éch. 18/12/2034	£	3 210	2 350	0,03
6,125 % éch. 21/01/2025		5 600	6 475	0,07
Lendlease Europe Finance PLC				
3,500 % éch. 02/12/2033		900	696	0,01
Lloyds Banking Group PLC				
2,438 % éch. 05/02/2026	$	6 100	5 684	0,06
3,511 % éch. 18/03/2026		1 600	1 521	0,02
3,750 % éch. 18/03/2028		4 600	4 253	0,05
4,450 % éch. 08/05/2025		21 500	21 108	0,24
4,976 % éch. 11/08/2033		1 300	1 197	0,01
Market Bidco Finco PLC				
4,750 % éch. 04/11/2027	€	19 800	17 050	0,19
Marks & Spencer PLC				
3,750 % éch. 19/05/2026	£	5 600	5 888	0,07
4,500 % éch. 10/07/2027		12 638	13 097	0,15
6,000 % éch. 12/06/2025		10 914	12 666	0,14
Mitchells & Butlers Finance PLC				
3,972 % éch. 15/12/2030		3 708	4 028	0,05
5,219 % éch. 15/12/2030	$	1 495	1 386	0,02
6,013 % éch. 15/12/2030	£	360	405	0,00
6,469 % éch. 15/09/2032		1 700	1 865	0,02
Nationwide Building Society				
4,363 % éch. 01/08/2024	$	30 500	30 108	0,34
5,750 % éch. 20/06/2027 (e)(g)	£	4 300	4 655	0,05
NatWest Group PLC				
1,750 % éch. 02/03/2026	€	5 600	5 629	0,06
2,000 % éch. 04/03/2025		500	521	0,01
4,800 % éch. 05/04/2026	$	40 275	39 435	0,45
4,892 % éch. 18/05/2029		17 200	16 305	0,19
6,000 % éch. 29/12/2025 (e)(g)		17 800	16 482	0,19
Pinnacle Bidco PLC				
5,500 % éch. 15/02/2025	€	900	845	0,01
6,375 % éch. 15/02/2025	£	2 200	2 307	0,03
Rolls-Royce PLC				
5,750 % éch. 15/10/2027	£	3 300	$ 3 654	0,04
5,750 % éch. 15/10/2027	$	2 600	2 481	0,03
Santander UK Group Holdings PLC				
3,823 % éch. 03/11/2028		18 124	16 225	0,18
6,750 % éch. 24/06/2024 (e)(g)	£	23 935	27 743	0,32
Tesco Property Finance PLC				
5,744 % éch. 13/04/2040		1 976	2 226	0,02
TP ICAP Finance PLC				
5,250 % éch. 26/01/2024		3 791	4 457	0,05
5,250 % éch. 29/05/2026		5 182	5 771	0,07
Travis Perkins PLC				
4,500 % éch. 07/09/2023		2 100	2 495	0,03
Virgin Media Secured Finance PLC				
4,125 % éch. 15/08/2030		27 700	25 575	0,29
4,250 % éch. 15/01/2030		24 600	23 088	0,26
Virgin Money UK PLC				
2,875 % éch. 24/06/2025	€	21 500	22 001	0,25
3,125 % éch. 22/06/2025	£	500	570	0,01
3,375 % éch. 24/04/2026		1 400	1 556	0,02
4,000 % éch. 25/09/2026		4 200	4 694	0,05
4,000 % éch. 03/09/2027		4 700	5 115	0,06
Vmed O2 UK Financing PLC				
3,250 % éch. 31/01/2031	€	7 450	6 351	0,07
4,000 % éch. 31/01/2029	£	38 700	36 474	0,42
4,500 % éch. 15/07/2031		9 100	8 409	0,10
			593 833	6,78
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
INEOS Finance PLC				
4,648 % éch. 08/11/2028	€	26 300	26 490	0,30
INEOS Quattro Holdings Ltd.				
4,648 % éch. 29/01/2026		4 900	4 920	0,06
			31 410	0,36
Total Royaume-Uni			625 243	7,14
ÉTATS-UNIS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Accredited Mortgage Loan Trust				
0,924 % éch. 25/04/2036	$	78	77	0,00
4,649 % éch. 25/09/2036		684	671	0,01
5,109 % éch. 25/09/2035		1 732	1 705	0,02
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
4,544 % éch. 25/08/2036		566	536	0,01
4,549 % éch. 25/08/2036 ^		2 364	632	0,01
4,689 % éch. 25/04/2036		273	263	0,00
4,689 % éch. 25/07/2036 ^		11 376	3 093	0,04
4,989 % éch. 25/02/2036		546	536	0,01
5,049 % éch. 25/11/2035		265	265	0,00
5,184 % éch. 25/01/2035		639	580	0,01
5,289 % éch. 25/12/2034		1 085	973	0,01
5,319 % éch. 25/02/2036 ^		70	66	0,00
5,364 % éch. 25/06/2034		460	417	0,01
Aegis Asset-Backed Securities Trust				
5,034 % éch. 25/12/2035		200	188	0,00
5,389 % éch. 25/03/2035 ^		241	223	0,00
Ameriquest Mortgage Securities Trust				
4,974 % éch. 25/03/2036		7	7	0,00
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
3,245 % éch. 25/11/2034		280	278	0,00
5,259 % éch. 25/07/2034		131	128	0,00
5,319 % éch. 25/05/2035		619	605	0,01
5,409 % éch. 25/09/2034		1 009	984	0,01
5,409 % éch. 25/10/2034		122	120	0,00
5,439 % éch. 25/11/2034		339	331	0,00
5,499 % éch. 25/03/2035		200	195	0,00
Amortizing Residential Collateral Trust				
5,389 % éch. 25/10/2034		89	87	0,00
Argent Securities Trust				
4,929 % éch. 25/05/2036		806	204	0,00
Asset-Backed Funding Certificates Trust				
4,499 % éch. 25/01/2037		185	109	0,00
4,549 % éch. 25/01/2037		640	380	0,01
4,609 % éch. 25/01/2037		213	127	0,00
5,439 % éch. 25/03/2034 ^		258	244	0,00
5,639 % éch. 25/06/2037		12 235	8 540	0,10
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
5,349 % éch. 25/07/2035	$	124	$ 123	0,00
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
4,421 % éch. 25/11/2035 ^		32	29	0,00
4,929 % éch. 25/06/2036		1	1	0,00
5,034 % éch. 25/12/2035		34	34	0,00
5,214 % éch. 25/06/2036		17	17	0,00
5,389 % éch. 25/10/2037		8	8	0,00
5,394 % éch. 25/06/2035		517	493	0,01
5,589 % éch. 25/01/2045		64	63	0,00
5,639 % éch. 25/08/2037		373	367	0,00
Carrington Mortgage Loan Trust				
4,549 % éch. 25/10/2036		751	612	0,01
4,609 % éch. 25/01/2037		1 200	867	0,01
4,639 % éch. 25/10/2036		751	612	0,01
4,649 % éch. 25/02/2037		2 301	2 068	0,02
4,869 % éch. 25/06/2036		2 184	2 099	0,02
Chase Funding Trust				
6,333 % éch. 25/04/2032		108	106	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust				
4,549 % éch. 25/01/2037		745	254	0,00
4,589 % éch. 25/05/2037		821	567	0,01
4,709 % éch. 25/09/2036		612	440	0,01
4,789 % éch. 25/11/2046		667	643	0,01
4,809 % éch. 25/12/2036		1 455	1 425	0,02
5,064 % éch. 25/11/2045		6	6	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
4,649 % éch. 25/03/2037		1 026	872	0,01
5,124 % éch. 25/09/2035 ^		164	162	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates				
4,889 % éch. 25/01/2046 ^		7 381	6 904	0,08
5,289 % éch. 25/03/2047 ^		55	45	0,00
5,489 % éch. 25/05/2047 ^		816	621	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,486 % éch. 25/07/2036		39	37	0,00
4,486 % éch. 25/07/2036		1 458	1 292	0,02
4,529 % éch. 25/07/2037 ^		673	660	0,01
4,539 % éch. 25/06/2047 ^		8	8	0,00
4,609 % éch. 25/06/2037		1 021	980	0,01
4,609 % éch. 25/09/2037 ^		78	80	0,00
4,619 % éch. 25/10/2047		1 214	1 193	0,01
4,689 % éch. 25/03/2047 ^		800	781	0,01
4,699 % éch. 25/09/2037 ^		653	564	0,01
4,709 % éch. 25/05/2036		33	40	0,00
4,740 % éch. 25/10/2035		0	0	0,00
4,869 % éch. 25/02/2037 ^		3 600	3 103	0,04
4,914 % éch. 25/08/2036		4 600	4 382	0,05
4,989 % éch. 25/06/2036		99	98	0,00
5,079 % éch. 25/05/2036		337	333	0,00
5,089 % éch. 25/03/2036 ^		1 471	1 330	0,02
5,229 % éch. 25/10/2047		4 018	3 877	0,05
5,379 % éch. 25/02/2036 ^		10 608	9 343	0,11
5,484 % éch. 25/07/2035		138	136	0,00
5,964 % éch. 25/11/2034		864	856	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.				
5,109 % éch. 25/07/2034		40	40	0,00
5,244 % éch. 25/08/2034		87	86	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.				
4,949 % éch. 25/04/2034		16	14	0,00
5,139 % éch. 25/03/2034		22	22	0,00
5,189 % éch. 25/08/2047		63	63	0,00
5,889 % éch. 25/02/2035		156	153	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
4,598 % éch. 25/01/2032		19	18	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				
4,264 % éch. 25/07/2037		187	125	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				
3,039 % éch. 25/07/2036		3 994	3 716	0,04
Ellington Loan Acquisition Trust				
5,439 % éch. 25/05/2037		2 182	2 072	0,02
EMC Mortgage Loan Trust				
5,489 % éch. 25/11/2041		3	3	0,00
First Franklin Mortgage Loan Trust				
4,709 % éch. 25/04/2036		137	132	0,00
4,869 % éch. 25/04/2036		400	362	0,00
4,869 % éch. 25/08/2036		152	141	0,00
5,109 % éch. 25/10/2035		48	48	0,00
5,334 % éch. 25/03/2035		56	55	0,00
5,589 % éch. 25/01/2035		90	89	0,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
5,814 % éch. 25/10/2034	$ 204	$ 201	0,00
6,264 % éch. 25/07/2034	904	886	0,01
First NLC Trust			
1,286 % éch. 25/05/2035	190	159	0,00
Fremont Home Loan Trust			
4,729 % éch. 25/02/2036	1 928	1 828	0,02
4,729 % éch. 25/02/2037	1 101	394	0,01
5,319 % éch. 25/06/2035 ^	3 077	2 741	0,03
GSAA Home Equity Trust			
4,509 % éch. 25/11/2036	416	109	0,00
4,629 % éch. 25/04/2047	78	72	0,00
5,289 % éch. 25/08/2037	53	51	0,00
GSAMP Trust			
3,312 % éch. 25/11/2034	372	355	0,00
4,439 % éch. 25/12/2046	239	120	0,00
4,479 % éch. 25/01/2037	278	169	0,00
4,529 % éch. 25/12/2036	5 880	3 187	0,04
4,929 % éch. 25/04/2036	2 986	1 927	0,02
4,974 % éch. 25/01/2036	148	148	0,00
Home Equity Asset Trust			
5,484 % éch. 25/07/2035	86	86	0,00
Home Equity Loan Trust			
4,729 % éch. 25/04/2037	2 000	1 756	0,02
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
4,529 % éch. 25/11/2036	312	279	0,00
4,629 % éch. 25/04/2037	821	543	0,01
4,769 % éch. 25/06/2036	84	82	0,00
HSI Asset Securitization Corp. Trust			
4,609 % éch. 25/12/2036	498	136	0,00
4,669 % éch. 25/01/2037	3 028	2 184	0,03
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
4,442 % éch. 25/01/2037 ^	500	277	0,00
4,579 % éch. 25/03/2047	628	621	0,01
4,629 % éch. 25/08/2036	40	39	0,00
4,649 % éch. 25/03/2037	126	122	0,00
4,649 % éch. 25/06/2037	171	170	0,00
4,669 % éch. 25/01/2037	135	134	0,00
4,689 % éch. 25/03/2037	4 349	4 074	0,05
4,794 % éch. 25/05/2036	6	6	0,00
4,794 % éch. 25/07/2036	161	155	0,00
Lehman ABS Mortgage Loan Trust			
4,479 % éch. 25/06/2037	253	179	0,00
4,589 % éch. 25/06/2037	130	92	0,00
Long Beach Mortgage Loan Trust			
4,569 % éch. 25/09/2036	14 365	4 111	0,05
4,929 % éch. 25/05/2046	2 508	849	0,01
4,989 % éch. 25/02/2036	11 516	9 472	0,11
5,034 % éch. 25/11/2035	60	60	0,00
5,439 % éch. 25/06/2035	293	284	0,00
5,664 % éch. 25/02/2035	2 043	2 000	0,02
MASTR Asset-Backed Securities Trust			
4,559 % éch. 25/10/2036	25	25	0,00
4,589 % éch. 25/08/2036	5 040	1 567	0,02
4,609 % éch. 25/08/2036	1 970	800	0,01
4,659 % éch. 25/08/2036	3 347	1 301	0,02
4,689 % éch. 25/03/2036	1 067	950	0,01
4,749 % éch. 25/02/2036	337	136	0,00
4,869 % éch. 25/03/2036	1 073	758	0,01
5,079 % éch. 25/03/2035	3	3	0,00
5,139 % éch. 25/10/2035 ^	300	277	0,00
5,169 % éch. 25/02/2034	482	457	0,01
5,289 % éch. 25/04/2034	343	332	0,00
5,289 % éch. 25/10/2035	2 625	2 285	0,03
MASTR Specialized Loan Trust			
5,514 % éch. 25/11/2035	145	135	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
4,689 % éch. 25/08/2037	2 774	1 476	0,02
4,839 % éch. 25/02/2047	108	65	0,00
5,109 % éch. 25/05/2036	74	73	0,00
5,439 % éch. 25/04/2035	107	103	0,00
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
4,459 % éch. 25/10/2036	68	32	0,00
4,519 % éch. 25/11/2036	311	145	0,00
4,519 % éch. 25/01/2037	906	449	0,01
4,529 % éch. 25/10/2036	1 975	948	0,01
4,529 % éch. 25/11/2036	195	98	0,00
4,529 % éch. 25/05/2037	3 535	2 488	0,03
4,539 % éch. 25/10/2036	177	88	0,00
4,539 % éch. 25/11/2036	3 003	1 814	0,02
4,589 % éch. 25/09/2036	3	1	0,00
4,609 % éch. 25/11/2036	$ 244	$ 122	0,00
4,639 % éch. 25/03/2037	928	420	0,01
4,709 % éch. 25/09/2036	1 191	538	0,01
4,969 % éch. 25/01/2035	686	677	0,01
5,009 % éch. 25/12/2035	148	143	0,00
5,034 % éch. 25/09/2035	30	30	0,00
5,094 % éch. 25/12/2034	86	81	0,00
5,094 % éch. 25/01/2035	1 380	1 274	0,02
5,244 % éch. 25/03/2034	430	418	0,01
5,259 % éch. 25/09/2035	4 254	3 496	0,04
5,379 % éch. 25/06/2035	1 156	1 129	0,01
5,639 % éch. 25/07/2037	400	333	0,00
6,289 % éch. 25/02/2047	761	663	0,01
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust			
4,749 % éch. 25/03/2036	99	80	0,00
Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust			
5,739 % éch. 25/02/2033	249	244	0,00
5,964 % éch. 25/11/2032	68	68	0,00
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust			
4,489 % éch. 25/12/2036	1 477	749	0,01
4,619 % éch. 25/04/2037	2 456	1 365	0,02
4,709 % éch. 25/04/2036	69	49	0,00
4,739 % éch. 25/04/2037	16 769	9 332	0,11
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
6,000 % éch. 25/02/2037 ^	57	35	0,00
6,459 % éch. 25/11/2036 ^	231	89	0,00
Morgan Stanley Structured Trust			
4,619 % éch. 25/06/2037	96	96	0,00
New Century Home Equity Loan Trust			
4,749 % éch. 25/05/2036	8	8	0,00
5,109 % éch. 25/03/2035	167	160	0,00
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust			
5,004 % éch. 25/02/2036	10	10	0,00
NovaStar Mortgage Funding Trust			
4,489 % éch. 25/01/2037	1 035	369	0,00
4,489 % éch. 25/03/2037	885	317	0,00
4,539 % éch. 25/03/2037	1 108	397	0,01
4,549 % éch. 25/09/2037	1 192	1 177	0,01
4,599 % éch. 25/01/2037	1 235	440	0,01
6,264 % éch. 25/03/2035	685	667	0,01
Option One Mortgage Loan Trust			
4,529 % éch. 25/01/2037	156	93	0,00
4,559 % éch. 25/05/2037	134	74	0,00
4,569 % éch. 25/04/2037	460	222	0,00
4,639 % éch. 25/07/2037	2 398	1 359	0,02
4,929 % éch. 25/01/2036	400	354	0,00
4,959 % éch. 25/01/2036	5 043	3 478	0,04
5,154 % éch. 25/08/2035	400	382	0,01
Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates			
5,079 % éch. 25/11/2035	451	428	0,01
Ownit Mortgage Loan Trust			
5,289 % éch. 25/10/2036 ^	131	120	0,00
Park Place Securities, Inc.			
5,124 % éch. 25/09/2035	200	195	0,00
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
5,124 % éch. 25/08/2035	394	376	0,00
5,124 % éch. 25/09/2035	6 708	6 422	0,07
5,184 % éch. 25/07/2035	117	115	0,00
5,214 % éch. 25/07/2035	400	367	0,00
5,334 % éch. 25/06/2035	37	36	0,00
5,379 % éch. 25/09/2034	22	22	0,00
5,439 % éch. 25/10/2034	319	313	0,00
5,514 % éch. 25/03/2035	307	296	0,00
5,634 % éch. 25/01/2036	93	91	0,00
6,189 % éch. 25/12/2034	406	392	0,01
People's Choice Home Loan Securities Trust			
5,366 % éch. 25/01/2035	541	512	0,01
People's Financial Realty Mortgage Securities Trust			
4,529 % éch. 25/09/2036	997	288	0,00
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust			
4,599 % éch. 25/01/2037	447	430	0,01
4,649 % éch. 25/11/2036	30	29	0,00
4,974 % éch. 25/02/2036	81	80	0,00
RAAC Trust			
4,739 % éch. 25/11/2046	169	151	0,00
4,989 % éch. 25/06/2044	54	44	0,00
4,989 % éch. 25/09/2045	91	88	0,00
5,589 % éch. 25/10/2045	$ 34	$ 34	0,00
5,889 % éch. 25/09/2047	403	386	0,01
Renaissance Home Equity Loan Trust			
5,340 % éch. 25/01/2037	1 247	410	0,01
Residential Asset Mortgage Products Trust			
5,029 % éch. 25/01/2036	442	415	0,01
Residential Asset Securities Corp. Trust			
4,649 % éch. 25/11/2036	265	241	0,00
4,729 % éch. 25/11/2036	71	66	0,00
4,949 % éch. 25/04/2036	29	29	0,00
4,989 % éch. 25/02/2036	145	142	0,00
5,019 % éch. 25/12/2035	88	87	0,00
5,049 % éch. 25/11/2035	37	37	0,00
5,049 % éch. 25/12/2035	161	143	0,00
5,229 % éch. 25/12/2034	7	6	0,00
Saxon Asset Securities Trust			
4,689 % éch. 25/05/2047	6 535	4 660	0,05
4,854 % éch. 25/03/2036	1 721	1 635	0,02
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
4,569 % éch. 25/07/2036	250	89	0,00
4,669 % éch. 25/07/2036	746	608	0,01
4,889 % éch. 25/03/2036	1 255	780	0,01
4,889 % éch. 25/05/2036	259	141	0,00
4,929 % éch. 25/03/2036	114	102	0,00
5,049 % éch. 25/08/2035 ^	115	87	0,00
SG Mortgage Securities Trust			
4,599 % éch. 25/10/2036	1 500	1 024	0,01
Soundview Home Loan Trust			
4,509 % éch. 25/11/2036	34	10	0,00
4,854 % éch. 25/06/2036 ^	16 680	14 273	0,16
4,869 % éch. 25/07/2036	200	176	0,00
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
3,595 % éch. 25/02/2037 ^	498	199	0,00
4,659 % éch. 25/04/2037	128	93	0,00
4,689 % éch. 25/11/2037	665	384	0,01
Structured Asset Investment Loan Trust			
4,539 % éch. 25/06/2036	26	25	0,00
4,539 % éch. 25/09/2036	145	139	0,00
4,989 % éch. 25/01/2036	108	105	0,00
5,064 % éch. 25/11/2035	6 999	6 138	0,07
5,154 % éch. 25/08/2035	4 589	4 348	0,05
5,289 % éch. 25/09/2034	47	46	0,00
5,319 % éch. 25/01/2035	283	274	0,00
5,364 % éch. 25/10/2033	27	26	0,00
5,514 % éch. 25/07/2033	22	21	0,00
5,769 % éch. 25/04/2033	11	11	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
4,519 % éch. 25/02/2037	42	42	0,00
4,619 % éch. 25/01/2037	2 117	1 284	0,02
4,639 % éch. 25/09/2036	9	9	0,00
4,729 % éch. 25/12/2036	215	210	0,00
4,809 % éch. 25/02/2037	153	148	0,00
5,289 % éch. 25/08/2037	41	40	0,00
Structured Asset Securities Corp. Trust			
5,079 % éch. 25/09/2035	177	168	0,00
Truman Capital Mortgage Loan Trust			
4,649 % éch. 25/03/2036	543	536	0,01
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust			
4,539 % éch. 25/01/2037	922	790	0,01
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust			
4,869 % éch. 25/05/2036	697	539	0,01
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
4,884 % éch. 25/05/2036	2 549	2 532	0,03
5,964 % éch. 25/02/2035	2	2	0,00
Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates			
5,129 % éch. 25/04/2034	159	155	0,00
		220 676	2,52

	ACTIONS		
ACTIONS ORDINAIRES			
ÉNERGIE			
Constellation Oil Services Holding S.A. « B » (b)(h)	844 339	92	0,00

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Alaska Airlines Pass-Through Trust				
4,800 % éch. 15/02/2029	$	2 614	$ 2 493	0,03
Ally Financial, Inc.				
8,000 % éch. 01/11/2031		12 675	13 131	0,15
American Airlines Pass-Through Trust				
3,000 % éch. 15/04/2030		217	188	0,00
3,150 % éch. 15/08/2033		2 690	2 234	0,03
3,200 % éch. 15/12/2029		3 813	3 315	0,04
3,350 % éch. 15/04/2031		2 799	2 423	0,03
3,375 % éch. 01/11/2028		3 943	3 296	0,04
3,575 % éch. 15/07/2029		2 286	2 045	0,02
3,650 % éch. 15/12/2029		4 317	3 378	0,04
3,650 % éch. 15/08/2030		4 403	3 927	0,04
3,700 % éch. 01/04/2028		3 685	3 187	0,04
Antares Holdings LP				
2,750 % éch. 15/01/2027		2 700	2 166	0,02
Aviation Capital Group LLC				
3,875 % éch. 01/05/2023		700	694	0,01
4,375 % éch. 30/01/2024		800	780	0,01
4,875 % éch. 01/10/2025		600	566	0,01
5,500 % éch. 15/12/2024		8 900	8 749	0,10
BAT Capital Corp.				
3,557 % éch. 15/08/2027		1 300	1 190	0,01
British Airways Pass-Through Trust				
2,900 % éch. 15/09/2036		1 279	1 045	0,01
4,250 % éch. 15/05/2034		2 471	2 218	0,03
Broadcom, Inc.				
2,450 % éch. 15/02/2031		8 900	7 031	0,08
3,187 % éch. 15/11/2036		2 600	1 876	0,02
Buckeye Partners LP				
4,125 % éch. 01/03/2025		8 400	8 013	0,09
Centene Corp.				
4,625 % éch. 15/12/2029		3 500	3 206	0,04
Charter Communications Operating LLC				
4,200 % éch. 15/03/2028		4 300	3 960	0,05
5,375 % éch. 01/04/2038		3 800	3 177	0,04
Chesapeake Energy Corp.				
5,500 % éch. 01/02/2026		1 500	1 449	0,02
Citigroup, Inc.				
2,572 % éch. 03/06/2031 (h)		6 900	5 596	0,06
CommScope, Inc.				
4,750 % éch. 01/09/2029		74 700	60 363	0,68
Community Health Systems, Inc.				
8,000 % éch. 15/03/2026		5 800	5 293	0,06
Coty, Inc.				
3,875 % éch. 15/04/2026	€	27 000	26 915	0,31
DAE Funding LLC				
1,550 % éch. 01/08/2024	$	15 800	14 693	0,17
1,625 % éch. 15/02/2024		13 500	12 821	0,15
2,625 % éch. 20/03/2025		7 700	7 214	0,08
3,375 % éch. 20/03/2028		8 700	7 735	0,09
Dell International LLC				
8,100 % éch. 15/07/2036		2 337	2 628	0,03
DISH DBS Corp.				
5,750 % éch. 01/12/2028		32 000	25 600	0,29
Edison International				
5,750 % éch. 15/06/2027		100	100	0,00
El Paso Natural Gas Co. LLC				
8,375 % éch. 15/06/2032		1 000	1 134	0,01
Energy Transfer LP				
4,950 % éch. 15/05/2028		14 763	14 187	0,16
5,950 % éch. 01/10/2043		200	185	0,00
6,050 % éch. 01/06/2041		3 811	3 597	0,04
6,100 % éch. 15/02/2042		800	737	0,01
6,500 % éch. 01/02/2042		7 140	7 089	0,08
6,625 % éch. 15/10/2036		800	805	0,01
7,500 % éch. 01/07/2038		12 865	13 719	0,16
EQT Corp.				
6,125 % éch. 01/02/2025		52 235	52 443	0,60
Fidelity National Financial, Inc.				
3,400 % éch. 15/06/2030		200	169	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC				
1,744 % éch. 19/07/2024	€	3 900	3 985	0,05
2,330 % éch. 25/11/2025		13 400	13 198	0,15
2,386 % éch. 17/02/2026		4 200	4 103	0,05
2,492 % éch. 15/11/2023		1 100	1 156	0,01
2,684 % éch. 01/12/2024	€	21 600	$ 22 289	0,25
2,700 % éch. 10/08/2026	$	13 600	11 827	0,14
2,748 % éch. 14/06/2024	£	9 700	11 057	0,13
3,021 % éch. 06/03/2024	€	13 400	14 051	0,16
3,250 % éch. 15/09/2025		4 000	4 066	0,05
3,625 % éch. 17/06/2031	$	26 300	20 694	0,24
3,664 % éch. 08/09/2024		1 300	1 241	0,01
3,815 % éch. 02/11/2027		1 200	1 057	0,01
4,125 % éch. 17/08/2027		6 100	5 474	0,06
4,271 % éch. 09/01/2027		1 700	1 541	0,02
4,389 % éch. 08/01/2026		1 800	1 681	0,02
4,535 % éch. 06/03/2025	£	2 800	3 209	0,04
4,542 % éch. 01/08/2026	$	1 900	1 754	0,02
5,125 % éch. 16/06/2025		1 525	1 469	0,02
5,584 % éch. 18/03/2024		7 800	7 715	0,09
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC				
5,500 % éch. 01/05/2028		19 600	16 747	0,19
6,500 % éch. 01/10/2025		13 461	12 680	0,14
Freedom Mortgage Corp.				
6,625 % éch. 15/01/2027		13 100	10 211	0,12
7,625 % éch. 01/05/2026		33 900	28 330	0,32
8,250 % éch. 15/04/2025		7 270	6 551	0,07
General Motors Co.				
6,800 % éch. 01/10/2027 (h)		1 700	1 767	0,02
Global Atlantic Fin Co.				
4,400 % éch. 15/10/2029		11 620	9 750	0,11
GLP Capital LP				
5,750 % éch. 01/06/2028		3 700	3 645	0,04
Gray Oak Pipeline LLC				
3,450 % éch. 15/10/2027		6 900	6 115	0,07
JetBlue Pass-Through Trust				
2,750 % éch. 15/11/2033		866	713	0,01
4,000 % éch. 15/05/2034		9 908	8 836	0,10
Kennedy-Wilson, Inc.				
4,750 % éch. 01/02/2030		24 300	18 560	0,21
Las Vegas Sands Corp.				
3,200 % éch. 08/08/2024		6 500	6 148	0,07
3,500 % éch. 18/08/2026		6 500	5 876	0,07
3,900 % éch. 08/08/2029		3 100	2 618	0,03
Lumen Technologies, Inc.				
4,000 % éch. 15/02/2027		1 300	1 105	0,01
Marriott International, Inc.				
4,625 % éch. 15/06/2030		900	842	0,01
Mattel, Inc.				
3,375 % éch. 01/04/2026		1 800	1 657	0,02
Midwest Connector Capital Co. LLC				
3,900 % éch. 01/04/2024		1 300	1 259	0,01
MPT Operating Partnership LP				
3,692 % éch. 05/06/2028	£	2 700	2 384	0,03
NGPL PipeCo LLC				
7,768 % éch. 15/12/2037	$	21 356	22 317	0,26
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
2,000 % éch. 09/03/2026		400	344	0,00
NuStar Logistics LP				
5,625 % éch. 28/04/2027		20 400	19 110	0,22
Omega Healthcare Investors, Inc.				
4,750 % éch. 15/01/2028		200	185	0,00
OneMain Finance Corp.				
5,625 % éch. 15/03/2023		600	599	0,01
6,125 % éch. 15/03/2024		9 600	9 307	0,11
6,875 % éch. 15/03/2025		11 800	11 362	0,13
7,125 % éch. 15/03/2026		3 458	3 296	0,04
Organon & Co.				
2,875 % éch. 30/04/2028	€	41 400	38 826	0,44
Pacific Gas & Electric Co.				
2,100 % éch. 01/08/2027	$	300	257	0,00
2,500 % éch. 01/02/2031		1 300	1 012	0,01
2,950 % éch. 01/03/2026 ^		600	551	0,01
3,150 % éch. 01/01/2026		8 400	7 814	0,09
3,300 % éch. 15/03/2027 ^		3 100	2 762	0,03
3,300 % éch. 01/12/2027 ^		2 800	2 476	0,03
3,300 % éch. 01/08/2040		25 900	17 624	0,20
3,400 % éch. 15/08/2024 ^		1 900	1 824	0,02
3,450 % éch. 01/07/2025		2 250	2 132	0,02
3,500 % éch. 15/06/2025 ^		2 000	1 889	0,02
3,750 % éch. 01/07/2028		2 350	2 089	0,02
3,950 % éch. 01/12/2047 ^		800	546	0,01
4,200 % éch. 01/06/2041		1 100	818	0,01
4,250 % éch. 15/03/2046 ^	$	2 000	$ 1 399	0,02
4,450 % éch. 15/04/2042 ^		3 500	2 618	0,03
4,500 % éch. 01/07/2040		9 396	7 378	0,08
4,550 % éch. 01/07/2030		6 000	5 452	0,06
4,600 % éch. 15/06/2043 ^		3 600	2 733	0,03
4,650 % éch. 01/08/2028		100	92	0,00
Piper Sandler Cos.				
5,200 % éch. 15/10/2023		4 300	4 262	0,05
Plains All American Pipeline LP				
5,150 % éch. 01/06/2042		12 177	9 919	0,11
6,650 % éch. 15/01/2037		6 790	6 707	0,08
Rio Oil Finance Trust				
9,250 % éch. 06/07/2024		12 266	12 451	0,14
9,750 % éch. 06/01/2027		1 663	1 730	0,02
RLJ Lodging Trust LP				
3,750 % éch. 01/07/2026		2 600	2 319	0,03
Rockies Express Pipeline LLC				
3,600 % éch. 15/05/2025		100	95	0,00
4,800 % éch. 15/05/2030		14 400	12 697	0,15
4,950 % éch. 15/07/2029		5 000	4 502	0,05
Sabine Pass Liquefaction LLC				
5,625 % éch. 01/03/2025		40 625	40 713	0,47
Santander Holdings USA, Inc.				
3,450 % éch. 02/06/2025		7 900	7 535	0,09
Spirit AeroSystems, Inc.				
9,375 % éch. 30/11/2029		900	949	0,01
Spirit Airlines Pass-Through Trust				
4,100 % éch. 01/10/2029		306	273	0,00
Standard Industries, Inc.				
2,250 % éch. 21/11/2026	€	38 000	34 851	0,40
4,750 % éch. 15/01/2028	$	3 450	3 110	0,04
Synchrony Financial				
5,150 % éch. 19/03/2029		300	285	0,00
Tallgrass Energy Partners LP				
5,500 % éch. 15/01/2028		3 400	3 021	0,03
6,000 % éch. 31/12/2030		7 450	6 452	0,07
Tennessee Gas Pipeline Co. LLC				
8,375 % éch. 15/06/2032		1 351	1 544	0,02
Time Warner Cable LLC				
4,500 % éch. 15/09/2042		1 200	883	0,01
6,750 % éch. 15/06/2039		1 700	1 616	0,02
Toll Brothers Finance Corp.				
4,875 % éch. 15/03/2027		9 600	9 181	0,10
U.S. Airways Pass-Through Trust				
3,950 % éch. 15/05/2027		2 130	1 938	0,02
United Airlines Pass-Through Trust				
2,700 % éch. 01/11/2033		973	788	0,01
2,900 % éch. 01/11/2029		2 285	1 839	0,02
3,100 % éch. 07/01/2030		736	665	0,01
3,450 % éch. 01/06/2029		823	733	0,01
3,450 % éch. 07/01/2030		1 472	1 242	0,01
3,500 % éch. 01/09/2031		1 250	1 082	0,01
4,000 % éch. 11/10/2027		589	548	0,01
4,150 % éch. 11/10/2025		1 995	1 933	0,02
4,150 % éch. 25/02/2033		309	274	0,00
5,875 % éch. 15/04/2029		30 825	30 434	0,35
VICI Properties LP				
3,500 % éch. 15/02/2025		3 200	3 022	0,03
VMware, Inc.				
4,700 % éch. 15/05/2030		3 900	3 637	0,04
Wells Fargo & Co.				
1,741 % éch. 04/05/2030	€	5 800	5 255	0,06
Wynn Las Vegas LLC				
5,250 % éch. 15/05/2027	$	700	633	0,01
Wynn Resorts Finance LLC				
5,125 % éch. 01/10/2029		9 400	8 072	0,09
			1 020 123	11,65
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Adient U.S. LLC				
7,634 % éch. 10/04/2028		5 319	5 272	0,06
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC				
6,603 % éch. 01/12/2027		28 581	28 568	0,33
Caesars Resort Collection LLC				
7,884 % éch. 21/07/2025		597	597	0,01
CenturyLink, Inc.				
6,634 % éch. 15/03/2027		35 284	33 573	0,38

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Charter Communications Operating LLC			
6,140 % éch. 01/02/2027	$ 48 724	$ 47 652	0,54
CommScope, Inc.			
7,634 % éch. 06/04/2026	774	732	0,01
Envision Healthcare Corp.			
TBD % éch. 29/04/2027 µ	215	211	0,00
12,119 % éch. 29/04/2027	1 185	1 159	0,01
15,744 % éch. 28/04/2028	54	44	0,00
Hilton Domestic Operating Co., Inc.			
6,173 % éch. 22/06/2026	27 523	27 470	0,31
INEOS Finance PLC			
3,898 % éch. 01/04/2024	€ 47 400	50 497	0,58
INEOS Styrolution U.S. Holding LLC			
7,134 % éch. 29/01/2026	$ 9 320	9 180	0,10
Level 3 Financing, Inc.			
6,134 % éch. 01/03/2027	17 978	17 273	0,20
Marriott Ownership Resorts, Inc.			
6,134 % éch. 29/08/2025	871	864	0,01
Standard Industries, Inc.			
6,425 % éch. 22/09/2028	11 345	11 221	0,13
Summer (BC) Holdco SARL			
6,222 % éch. 04/12/2026	€ 5 000	5 028	0,06
		239 341	2,73
OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX			
Obligations Massachusetts, Port Authority Special Facilities Revenue Bonds, Series 2011			
6,202 % éch. 01/07/2031	$ 465	477	0,01
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES			
Adjustable Rate Mortgage Trust			
3,208 % éch. 25/01/2036 ^	61	56	0,00
3,769 % éch. 25/02/2036 ^	83	59	0,00
American Home Mortgage Assets Trust			
4,769 % éch. 25/09/2046 ^	516	438	0,01
6,750 % éch. 25/06/2037 ^	113	95	0,00
American Home Mortgage Investment Trust			
6,959 % éch. 25/12/2035	703	251	0,00
Angel Oak Mortgage Trust			
1,469 % éch. 25/06/2065	222	199	0,00
Banc of America Alternative Loan Trust			
6,000 % éch. 25/06/2046 ^	98	85	0,00
6,000 % éch. 25/07/2046 ^	102	85	0,00
Banc of America Funding Trust			
3,635 % éch. 20/09/2035 ^	89	71	0,00
3,721 % éch. 20/09/2047 ^	84	69	0,00
4,273 % éch. 20/01/2047 ^	241	221	0,00
4,679 % éch. 25/07/2037	252	232	0,00
4,773 % éch. 20/04/2047 ^	259	203	0,00
5,189 % éch. 25/05/2037 ^	62	54	0,00
5,750 % éch. 25/03/2036	86	71	0,00
Banc of America Mortgage Trust			
2,843 % éch. 25/02/2036 ^	2	2	0,00
3,348 % éch. 25/01/2035	32	31	0,00
3,942 % éch. 25/07/2035 ^	7	6	0,00
6,000 % éch. 25/10/2036 ^	27	22	0,00
BCAP LLC Trust			
3,998 % éch. 26/05/2037	4 693	3 999	0,05
4,829 % éch. 25/05/2047 ^	192	180	0,00
5,689 % éch. 25/09/2047	54	47	0,00
6,250 % éch. 26/08/2036	1 940	960	0,01
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
2,839 % éch. 25/06/2035 ^	7	6	0,00
2,888 % éch. 25/05/2034	19	17	0,00
3,372 % éch. 25/03/2035	32	29	0,00
3,474 % éch. 25/07/2036 ^	20	17	0,00
3,696 % éch. 25/06/2047 ^	96	86	0,00
3,810 % éch. 25/01/2035	2	2	0,00
3,845 % éch. 25/02/2036 ^	33	29	0,00
3,857 % éch. 25/10/2035	26	25	0,00
3,874 % éch. 25/01/2035	102	94	0,00
3,883 % éch. 25/07/2034	21	20	0,00
6,662 % éch. 25/12/2046 ^	71	57	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust			
3,257 % éch. 25/05/2036 ^	468	283	0,00
3,374 % éch. 25/03/2036	338	203	0,00
3,602 % éch. 25/11/2036	245	140	0,00
3,697 % éch. 25/08/2036 ^	$ 257	$ 137	0,00
3,729 % éch. 25/09/2035 ^	67	42	0,00
4,709 % éch. 25/01/2047 ^	137	108	0,00
4,829 % éch. 25/04/2036 ^	78	108	0,00
5,364 % éch. 25/07/2035	8 500	7 534	0,09
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust			
3,523 % éch. 26/01/2036 ^	107	86	0,00
Chase Mortgage Finance Trust			
3,393 % éch. 25/03/2037 ^	48	43	0,00
3,499 % éch. 25/01/2036 ^	222	189	0,00
3,824 % éch. 25/03/2037 ^	205	187	0,00
4,989 % éch. 25/02/2037	46	15	0,00
6,000 % éch. 25/11/2036 ^	57	26	0,00
6,000 % éch. 25/03/2037 ^	115	62	0,00
ChaseFlex Trust			
4,689 % éch. 25/07/2037	146	140	0,00
6,300 % éch. 25/06/2036 ^	58	49	0,00
Citicorp Mortgage Securities Trust			
6,000 % éch. 25/09/2037	29	28	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust			
2,358 % éch. 25/03/2034	3	3	0,00
2,960 % éch. 25/10/2046 ^	66	58	0,00
2,994 % éch. 25/09/2037	26	26	0,00
3,223 % éch. 25/03/2037 ^	2 935	2 455	0,03
3,693 % éch. 25/07/2046 ^	174	156	0,00
3,871 % éch. 25/09/2037 ^	71	61	0,00
3,907 % éch. 25/09/2037 ^	133	117	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
2,409 % éch. 25/02/2034	16	15	0,00
6,080 % éch. 25/09/2035	8	8	0,00
CitiMortgage Alternative Loan Trust			
6,000 % éch. 25/01/2037 ^	45	40	0,00
6,000 % éch. 25/06/2037 ^	561	480	0,01
Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust			
6,000 % éch. 25/05/2036 ^	222	135	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust			
3,131 % éch. 25/05/2036	182	160	0,00
3,528 % éch. 25/01/2036	350	319	0,01
4,533 % éch. 20/02/2047 ^	167	127	0,00
4,543 % éch. 20/09/2046	142	135	0,00
4,563 % éch. 20/07/2046 ^	66	49	0,00
4,669 % éch. 25/08/2037	364	317	0,01
4,669 % éch. 25/04/2047	4 238	3 688	0,04
4,739 % éch. 25/08/2036 ^	56	25	0,00
4,749 % éch. 25/11/2036	34	37	0,00
4,769 % éch. 25/07/2046 ^	45	43	0,00
4,769 % éch. 25/09/2046 ^	201	186	0,00
4,773 % éch. 20/03/2046	85	67	0,00
4,773 % éch. 20/05/2046 ^	1 402	1 157	0,02
4,869 % éch. 25/12/2046 ^	2 790	1 726	0,02
4,889 % éch. 25/06/2035	78	65	0,00
4,889 % éch. 25/04/2036	3 216	1 199	0,02
4,909 % éch. 25/07/2035	59	50	0,00
5,009 % éch. 25/08/2035 ^	82	70	0,00
5,013 % éch. 20/11/2035	283	248	0,00
5,250 % éch. 25/06/2035 ^	237	185	0,00
5,500 % éch. 25/02/2035	918	881	0,01
5,500 % éch. 25/11/2035 ^	368	216	0,00
5,500 % éch. 25/11/2035	1 350	816	0,01
5,500 % éch. 25/12/2035 ^	540	356	0,01
5,500 % éch. 25/05/2036 ^	308	128	0,00
5,541 % éch. 25/02/2036	293	237	0,00
5,750 % éch. 25/01/2035	198	186	0,00
5,750 % éch. 25/07/2037	353	221	0,00
6,000 % éch. 25/03/2035 ^	4 231	2 082	0,03
6,000 % éch. 25/02/2036 ^	140	72	0,00
6,000 % éch. 25/03/2036 ^	350	166	0,00
6,000 % éch. 25/08/2036 ^	56	34	0,00
6,000 % éch. 25/08/2036 ^	158	97	0,00
6,000 % éch. 25/01/2037 ^	547	444	0,01
6,000 % éch. 25/02/2037 ^	2 015	858	0,01
6,000 % éch. 25/03/2037 ^	491	196	0,00
6,000 % éch. 25/04/2037 ^	1 495	739	0,01
6,000 % éch. 25/05/2037 ^	194	95	0,00
6,000 % éch. 25/06/2037 ^	212	105	0,00
6,000 % éch. 25/08/2037 ^	41	21	0,00
6,000 % éch. 25/02/2047 ^	309	159	0,00
6,250 % éch. 25/12/2036 ^	240	111	0,00
6,500 % éch. 25/08/2032	14	14	0,00
6,500 % éch. 25/09/2037 ^	9 093	3 855	0,05
6,500 % éch. 25/11/2037 ^	810	408	0,01
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
2,964 % éch. 20/10/2035	$ 3	$ 3	0,00
3,008 % éch. 25/04/2046 ^	747	239	0,00
3,031 % éch. 25/09/2037 ^	37	34	0,00
3,375 % éch. 25/10/2035 ^	221	175	0,00
3,527 % éch. 20/12/2035	20	18	0,00
3,537 % éch. 25/03/2037 ^	46	40	0,00
3,632 % éch. 25/09/2047 ^	4	4	0,00
4,081 % éch. 20/11/2035 ^	84	68	0,00
4,889 % éch. 25/03/2036	95	78	0,00
4,929 % éch. 25/04/2046	7 068	2 056	0,03
5,069 % éch. 25/03/2035 ^	48	42	0,00
5,500 % éch. 25/10/2034	393	375	0,01
5,500 % éch. 25/09/2035 ^	121	104	0,00
5,500 % éch. 25/10/2035	48	28	0,00
6,000 % éch. 25/05/2036 ^	120	60	0,00
6,000 % éch. 25/02/2037 ^	526	384	0,01
6,000 % éch. 25/03/2037 ^	31	15	0,00
6,000 % éch. 25/09/2037 ^	26	15	0,00
6,250 % éch. 25/09/2036 ^	625	244	0,00
6,500 % éch. 25/11/2036 ^	164	65	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
3,187 % éch. 25/06/2033	10	9	0,00
6,000 % éch. 25/01/2036 ^	259	152	0,00
6,500 % éch. 25/04/2033	0	0	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates			
3,323 % éch. 28/04/2037	175	161	0,00
3,635 % éch. 27/09/2035	1 494	1 249	0,02
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust			
6,000 % éch. 25/07/2036	743	398	0,01
6,000 % éch. 25/04/2037 ^	166	65	0,00
6,500 % éch. 25/02/2022 ^	616	80	0,00
6,750 % éch. 25/08/2036 ^	654	384	0,01
7,000 % éch. 25/08/2037 ^	622	343	0,01
Credit Suisse Mortgage Capital Trust			
3,623 % éch. 25/10/2043	901	849	0,01
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust			
4,769 % éch. 25/08/2047	98	85	0,00
Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.			
3,854 % éch. 27/11/2036	80	79	0,00
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust			
4,435 % éch. 25/06/2036 ^	44	35	0,00
6,250 % éch. 25/08/2037 ^	63	27	0,00
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust			
4,267 % éch. 25/09/2035	289	267	0,00
Greenpoint Mortgage Funding Trust			
4,789 % éch. 25/10/2046 ^	183	160	0,00
4,929 % éch. 25/04/2036 ^	84	76	0,00
GSR Mortgage Loan Trust			
2,954 % éch. 25/04/2035	16	15	0,00
3,061 % éch. 25/11/2035	45	45	0,00
3,466 % éch. 25/03/2047 ^	265	174	0,00
3,760 % éch. 25/04/2032	26	22	0,00
3,796 % éch. 25/01/2036 ^	12	11	0,00
3,955 % éch. 25/09/2035	46	45	0,00
4,729 % éch. 25/12/2034	5	4	0,00
5,750 % éch. 25/02/2036	156	137	0,00
5,750 % éch. 25/03/2036 ^	38	34	0,00
5,750 % éch. 25/01/2037 ^	95	61	0,00
6,000 % éch. 25/02/2036 ^	360	189	0,00
6,500 % éch. 25/09/2036 ^	254	127	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust			
3,321 % éch. 19/08/2036 ^	1	1	0,00
3,446 % éch. 19/08/2036 ^	50	39	0,00
3,482 % éch. 19/07/2035 ^	3	3	0,00
3,764 % éch. 19/06/2036 ^	177	83	0,00
4,819 % éch. 19/06/2035	252	236	0,00
4,879 % éch. 19/03/2035	21	20	0,00
4,959 % éch. 19/11/2035	189	145	0,00
5,039 % éch. 19/01/2035	221	193	0,00
HomeBanc Mortgage Trust			
4,749 % éch. 25/12/2036	46	45	0,00
4,889 % éch. 25/03/2035	105	88	0,00
4,909 % éch. 25/01/2036	122	115	0,00
HSI Asset Securitization Corp. Trust			
4,829 % éch. 25/11/2035	1 303	1 209	0,02
Impac Secured Assets Trust			
4,609 % éch. 25/05/2037 ^	44	34	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust			
2,824 % éch. 25/06/2037 ^	44	36	0,00

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
3,064 % éch. 25/07/2037	$ 49	$ 31	0,00
3,088 % éch. 25/05/2037 ^	145	122	0,00
3,129 % éch. 25/06/2036	117	92	0,00
3,229 % éch. 25/08/2035	640	513	0,01
3,249 % éch. 25/11/2035 ^	26	19	0,00
3,453 % éch. 25/11/2035 ^	477	393	0,01
3,644 % éch. 25/12/2036 ^	63	54	0,00
3,645 % éch. 25/06/2035 ^	168	144	0,00
3,833 % éch. 25/10/2034	233	221	0,00
4,749 % éch. 25/07/2047	179	124	0,00
4,789 % éch. 25/06/2046	579	450	0,01
4,809 % éch. 25/07/2036	5 622	4 943	0,06
4,869 % éch. 25/07/2035	6	5	0,00
4,989 % éch. 25/07/2035	139	113	0,00
JPMorgan Alternative Loan Trust			
3,133 % éch. 25/05/2036 ^	170	97	0,00
3,854 % éch. 25/05/2037 ^	197	164	0,00
4,709 % éch. 25/10/2036	918	806	0,01
5,843 % éch. 26/05/2037	1 671	1 298	0,02
JPMorgan Mortgage Trust			
3,169 % éch. 25/06/2037 ^	211	159	0,00
3,407 % éch. 25/08/2035	36	34	0,00
3,570 % éch. 25/07/2035	12	12	0,00
3,614 % éch. 25/10/2036 ^	287	217	0,00
3,615 % éch. 25/10/2035 ^	141	114	0,00
3,879 % éch. 25/11/2035 ^	106	92	0,00
4,157 % éch. 25/04/2035	2	2	0,00
6,000 % éch. 25/01/2036 ^	96	49	0,00
6,500 % éch. 25/07/2036 ^	242	109	0,00
Lehman XS Trust			
4,749 % éch. 25/12/2036	2 172	2 039	0,03
4,849 % éch. 25/04/2046 ^	7	8	0,00
4,869 % éch. 25/09/2046 ^	11	12	0,00
4,909 % éch. 25/02/2046 ^	196	170	0,00
4,944 % éch. 25/08/2047 ^	434	373	0,01
5,744 % éch. 25/10/2037	1 992	1 739	0,02
Luminent Mortgage Trust			
4,789 % éch. 25/10/2046	908	786	0,01
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			
3,874 % éch. 21/11/2034	51	46	0,00
4,644 % éch. 25/05/2047 ^	5	5	0,00
Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust			
4,609 % éch. 25/03/2037	227	65	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
2,736 % éch. 25/03/2036 ^	336	185	0,00
2,847 % éch. 25/02/2036	20	19	0,00
3,455 % éch. 25/05/2036	161	143	0,00
4,138 % éch. 25/11/2035	92	88	0,00
4,676 % éch. 25/11/2029	3	3	0,00
4,849 % éch. 25/04/2029	14	13	0,00
Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust			
2,861 % éch. 25/04/2037 ^	21	19	0,00
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
3,684 % éch. 25/05/2036 ^	394	232	0,00
3,711 % éch. 25/09/2035 ^	149	55	0,00
3,736 % éch. 25/06/2036	29	28	0,00
4,386 % éch. 25/06/2036	3	3	0,00
4,649 % éch. 25/03/2036	54	35	0,00
4,709 % éch. 25/01/2035	18	16	0,00
6,000 % éch. 25/10/2037 ^	1 123	661	0,01
Morgan Stanley Re-REMIC Trust			
2,666 % éch. 26/03/2037	79	74	0,00
2,702 % éch. 26/02/2037	107	96	0,00
New Residential Mortgage Loan Trust			
3,500 % éch. 25/12/2057	1 708	1 618	0,02
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust			
4,038 % éch. 25/08/2035	30	30	0,00
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
4,949 % éch. 25/12/2035	305	279	0,00
6,414 % éch. 25/02/2035	409	416	0,01
Prime Mortgage Trust			
6,000 % éch. 25/06/2036 ^	10	9	0,00
RBSGC Structured Trust			
5,500 % éch. 25/11/2035 ^	77	65	0,00
Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
3,430 % éch. 25/02/2035 ^	54	44	0,00
3,999 % éch. 25/08/2035	1 047	955	0,01
4,539 % éch. 25/02/2047	728	268	0,00
4,589 % éch. 25/05/2037	$ 338	$ 289	0,01
4,649 % éch. 25/02/2037	10	23	0,00
4,669 % éch. 25/01/2037	121	123	0,00
4,689 % éch. 25/02/2037	229	199	0,00
4,739 % éch. 25/08/2035 ^	441	357	0,01
4,769 % éch. 25/08/2036 ^	124	119	0,00
4,769 % éch. 25/09/2036 ^	449	410	0,01
4,789 % éch. 25/11/2036 ^	149	110	0,00
4,819 % éch. 25/05/2046	617	516	0,01
5,500 % éch. 25/03/2037 ^	74	57	0,00
6,000 % éch. 25/09/2035 ^	77	28	0,00
6,000 % éch. 25/06/2036 ^	377	305	0,01
6,000 % éch. 25/08/2036 ^	847	664	0,01
6,250 % éch. 25/03/2037 ^	169	128	0,00
6,500 % éch. 25/07/2037 ^	240	192	0,00
6,500 % éch. 25/09/2037 ^	231	183	0,00
Residential Asset Securitization Trust			
5,500 % éch. 25/09/2035 ^	84	43	0,00
5,500 % éch. 25/12/2035 ^	203	103	0,00
6,500 % éch. 25/04/2037 ^	1 209	327	0,01
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust			
6,000 % éch. 25/10/2036 ^	109	87	0,00
6,000 % éch. 25/06/2037 ^	72	53	0,00
Sequoia Mortgage Trust			
2,976 % éch. 20/01/2047 ^	4	3	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
3,530 % éch. 25/11/2035 ^	23	21	0,00
3,637 % éch. 25/09/2035	21	16	0,00
3,658 % éch. 25/10/2036 ^	80	47	0,00
3,838 % éch. 25/09/2035	77	68	0,00
3,854 % éch. 25/04/2035	10	9	0,00
4,022 % éch. 25/11/2036 ^	355	298	0,01
4,115 % éch. 25/02/2035	164	153	0,00
4,709 % éch. 25/10/2035	68	62	0,00
4,829 % éch. 25/06/2037	123	104	0,00
6,709 % éch. 25/10/2037 ^	71	63	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust			
4,569 % éch. 25/09/2047	38	34	0,00
4,579 % éch. 25/09/2047	414	362	0,01
4,749 % éch. 25/07/2046	138	113	0,00
4,769 % éch. 25/06/2036	49	47	0,00
4,809 % éch. 25/04/2036	37	32	0,00
4,809 % éch. 25/05/2036	30	23	0,00
4,989 % éch. 25/08/2036 ^	394	247	0,00
4,999 % éch. 19/10/2034	25	23	0,00
5,039 % éch. 19/03/2034	4	3	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates			
5,041 % éch. 25/06/2033	5	5	0,00
SunTrust Alternative Loan Trust			
5,039 % éch. 25/12/2035 ^	153	130	0,00
5,750 % éch. 25/12/2035 ^	176	149	0,00
Thornburg Mortgage Securities Trust			
2,994 % éch. 25/09/2037	18	17	0,00
Towd Point Mortgage Trust			
2,750 % éch. 25/06/2057	649	619	0,01
Wachovia Mortgage Loan Trust LLC			
4,160 % éch. 20/10/2035 ^	38	36	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
2,499 % éch. 25/12/2046	50	44	0,00
2,710 % éch. 25/01/2037 ^	14	12	0,00
2,737 % éch. 25/05/2046	66	55	0,00
2,766 % éch. 25/04/2037 ^	9	8	0,00
2,835 % éch. 27/02/2034	129	120	0,00
2,858 % éch. 25/07/2047	457	366	0,01
2,987 % éch. 25/04/2035	12	11	0,00
3,048 % éch. 25/08/2046	282	258	0,00
3,122 % éch. 25/03/2036	117	105	0,00
3,206 % éch. 25/06/2033	31	29	0,00
3,211 % éch. 25/02/2037 ^	30	27	0,00
3,248 % éch. 25/11/2042	4	4	0,00
3,347 % éch. 25/05/2037 ^	15	12	0,00
3,367 % éch. 25/07/2037 ^	484	405	0,01
3,372 % éch. 25/12/2036 ^	23	21	0,00
3,448 % éch. 25/04/2044	2	1	0,00
3,452 % éch. 25/02/2033	9	8	0,00
3,510 % éch. 25/12/2036 ^	9	7	0,00
3,548 % éch. 25/10/2046	18	16	0,00
3,672 % éch. 25/10/2036 ^	269	232	0,00
3,683 % éch. 25/08/2036 ^	48	44	0,00
3,738 % éch. 25/09/2036 ^	$ 117	$ 106	0,00
3,836 % éch. 25/12/2035	68	62	0,00
4,969 % éch. 25/10/2045	28	26	0,00
5,029 % éch. 25/01/2045	307	285	0,01
5,129 % éch. 25/11/2034	288	260	0,00
5,229 % éch. 25/06/2044	262	236	0,00
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
4,466 % éch. 25/05/2035 ^	223	190	0,00
4,709 % éch. 25/02/2037 ^	579	476	0,01
5,500 % éch. 25/07/2035 ^	446	396	0,01
5,500 % éch. 25/11/2035 ^	122	109	0,00
6,000 % éch. 25/06/2037 ^	485	471	0,01
Wells Fargo Alternative Loan Trust			
5,750 % éch. 25/07/2037 ^	56	45	0,00
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust			
2,755 % éch. 25/04/2036 ^	161	149	0,00
2,954 % éch. 25/04/2036 ^	8	7	0,00
4,414 % éch. 25/11/2037 ^	74	63	0,00
4,564 % éch. 25/12/2036 ^	60	57	0,00
6,000 % éch. 25/06/2037 ^	2 069	1 737	0,02
		89 113	1,02
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Uniform Mortgage-Backed Security			
5,500 % éch. 01/12/2052	16 307	16 366	0,19
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
5,000 % éch. 01/01/2053	154 300	152 052	1,74
5,500 % éch. 01/02/2053	147 900	148 236	1,69
		316 654	3,62
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Obligations du Trésor américain			
4,000 % éch. 15/11/2042	98 500	96 468	1,10
Total États-Unis		1 982 944	22,65
VENEZUELA			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Petroleos de Venezuela S.A.			
6,000 % éch. 16/05/2024 ^	8 400	431	0,00
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement vénézuélien			
6,000 % éch. 09/12/2020 ^	2 651	186	0,00
7,000 % éch. 31/03/2038 ^	16 792	1 511	0,02
9,250 % éch. 07/05/2028 ^	7 813	703	0,01
		2 400	0,03
Total Venezuela		2 831	0,03
ÎLES VIERGES BRITANNIQUES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Champion Path Holdings Ltd.			
4,500 % éch. 27/01/2026	5 700	4 977	0,06
4,850 % éch. 27/01/2028	200	169	0,00
Total Îles Vierges britanniques		5 146	0,06
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BILLETS À COURT TERME			
Corestate Capital Holding S.A.			
8,000 % éch. 15/04/2023 (h)	€ 1 700	1 815	0,02
Federal Home Loan Bank			
4,340 % éch. 10/02/2023	$ 81 700	81 703	0,94
4,345 % éch. 06/03/2023	158 400	158 411	1,81
		241 929	2,77
BONS DU TRÉSOR HONGROIS			
18,250 % éch. 03/01/2023 (c)(d)	HUF 3 405 000	$ 9 075	0,10
Total instruments à court terme		251 004	2,87
Total des valeurs mobilières		**$ 6 620 617**	**75,64**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (f)	3 488 745	30 701	0,35
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - PIMCO Asia High Yield Bond Fund (f)	7 821 400	71 409	0,82
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (f)	3 637 652	$ 38 357	0,44
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - US Short-Term Fund (f)	32 636 754	325 715	3,73
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	14 376 805	143 107	1,63
		609 289	**6,97**
FONDS INDICIELS COTÉS			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)	2 698 640	267 341	3,05
Total Fonds d'investissement*		**$ 876 630**	**10,02**

*** L'exposition du Fonds Diversified Income Fund aux Fonds d'investissement a légèrement dépassé 10 % en raison des fluctuations de la valeur de marché au 27 décembre 2022. Le Fonds est revenu au niveau conforme le 04 janvier 2023.**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux directeur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Accords de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BOS	4,290 %	29/12/2022	05/01/2023	$500 000	Obligations du Trésor américain 3,375 % - 3,750 % échéance 15/11/2043 - 15/11/2048	$ (513 516)	$ 500 000	$ 500 417	5,71
BRC	4,290	30/12/2022	03/01/2023	568 200	Freddie Mac 4,000 % échéance 01/07/2052	(139 541)	568 200	568 471	6,49
					Ginnie Mae 2,500 % - 4,500 % échéance 20/01/2052 - 20/12/2052	(450 224)			
CIB	4,250	03/01/2023	04/01/2023	580 100	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/04/2025 - 15/07/2031	(592 195)	580 100	580 168	6,63
FICC	1,900	30/12/2022	03/01/2023	41 323	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 29/06/2023	(42 150)	41 323	41 327	0,47
MBC	4,320	30/12/2022	03/01/2023	56 700	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 05/01/2023	(58 078)	56 700	56 727	0,65
Total des contrats de mise en pension						**$ (1 795 704)**	**$ 1 746 323**	**$ 1 747 110**	**19,95**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars	Longue	03/2023	156	$ (699)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Longue	03/2023	1 200	(4 733)	(0,05)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars	À découvert	03/2023	8 388	5 501	0,06
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Longue	03/2023	3 590	398	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Longue	03/2023	7 735	(7 173)	(0,08)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Longue	03/2023	9 644	(9 239)	(0,11)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Longue	03/2023	6 474	(12 135)	(0,14)
				$ (28 080)	(0,32)
Total des instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé				**$ (28 080)**	**(0,32)**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AT&T, Inc.	1,000 %	20/06/2024	$ 18 200	$ 23	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	17 200	(295)	0,00
Auchan Holding S.A.	1,000	20/12/2027	€ 2 400	(85)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2023	$ 1 300	(9)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2026	500	(3)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2027	1 200	48	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20/12/2023	3 700	(616)	(0,01)

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20/12/2024	$ 600	$ 4	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2025	1 300	18	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2026	800	15	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2027	6 900	(56)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2024	14 300	398	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	35 000	(37)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2026	4 300	(28)	0,00
General Motors Co.	5,000	20/06/2026	4 200	(370)	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20/12/2025	€ 35 900	(3 993)	(0,05)
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20/12/2027	26 000	(3 368)	(0,04)
Marks & Spencer PLC	1,000	20/12/2024	18 600	487	0,01
Marks & Spencer PLC	1,000	20/06/2027	2 862	(46)	0,00
Marks & Spencer PLC	1,000	20/12/2028	14 000	(1 098)	(0,01)
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2024	40 600	(865)	(0,01)
Volkswagen International Finance NV	1,000	20/12/2026	19 300	(576)	(0,01)
Volkswagen International Finance NV	1,000	20/06/2027	8 300	132	0,00
				$ (10 320)	(0,12)

SWAPS DE DÉFAILLANCE DE CRÉDIT SUR INDICES DE CRÉDIT – VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant du notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.EM-34 à 5 ans	1,000 %	20/12/2025	$ 167 463	$ (734)	(0,01)
Indice CDX.EM-35 à 5 ans	1,000	20/06/2026	3 726	18	0,00
Indice CDX.EM-36 à 5 ans	1,000	20/12/2026	492 490	692	0,01
Indice CDX.EM-37 à 5 ans	1,000	20/06/2027	4 606	149	0,00
Indice CDX.EM-38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	183 200	4 563	0,05
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000	20/12/2027	260 600	4 534	0,05
Indice CDX.IG-38 à 5 ans	1,000	20/06/2027	201 100	1 442	0,02
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000	20/12/2027	656 100	4 709	0,06
				$ 15 373	0,18

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Fixe recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	0,500 %	16/09/2025	£ 21 100	$ 2 627	0,03
À recevoir[3]	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2033	5 500	(130)	0,00
À payer[3]	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053	13 200	(343)	0,00
À recevoir[3]	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	2,250	15/03/2028	47 400	1 676	0,02
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,400	15/06/2032	¥ 12 250 000	2 684	0,03
À payer	Billet CAD-Bank à 3 mois	0,880	03/03/2024	CAD 273 400	(11 225)	(0,13)
À payer	Billet CAD-Bank à 3 mois	2,500	19/06/2029	91 700	(8 005)	(0,09)
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053	€ 5 000	413	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,520	07/07/2027	127 500	(6 096)	(0,07)
					$ (18 399)	(0,21)
Total des instruments financiers dérivés compensés					**$ (13 346)**	**(0,15)**

(1) Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(2) Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, tel que défini par les termes de ce contrat de swap précis.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Voir note 2, Transactions sur titres et revenus sur investissements, dans les Notes relatives aux États financiers pour plus d'informations.

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

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

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente – Indice hors cote iTraxx Europe 37 à 5 ans	Vente	3,000 %	15/03/2023	25 100	$ (45)	$ (5)	0,00

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant du notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BRC	Obligation internationale du gouvernement indonésien	1,000 %	20/06/2031	$ 61 600	$ (2 646)	$ 554	$ (2 092)	(0,03)
	Intrum AB	5,000	20/12/2024	€ 1 200	113	(141)	(28)	0,00
FBF	Intrum AB	5,000	20/12/2024	4 400	415	(519)	(104)	0,00
GST	ADLER Real Estate AG	5,000	20/12/2026	7 400	(46)	(1 849)	(1 895)	(0,02)
	Intrum AB	5,000	20/12/2024	41 200	4 387	(5 365)	(978)	(0,01)
JPM	Hochtief AG	5,000	20/12/2026	34 200	8 143	(4 179)	3 964	0,04
	Intrum AB	5,000	20/12/2024	1 000	92	(116)	(24)	0,00
MYC	Intrum AB	5,000	20/12/2024	6 400	650	(802)	(152)	0,00
MYI	Intrum AB	5,000	20/12/2024	8 200	893	(1 088)	(195)	0,00
					$ 12 001	$ (13 505)	$ (1 504)	(0,02)

(1) Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(2) Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, tel que défini par les termes de ce contrat de swap précis.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	AUD	10	$	7	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BPS	01/2023	HUF	542 086		1 412	0	(32)	(32)	0,00
	01/2023	$	1 050	£	871	0	(2)	(2)	0,00
	02/2023	IDR	2 847 249	$	181	0	(3)	(3)	0,00
	03/2023	INR	52 179		629	2	0	2	0,00
	03/2023	MXN	75 325		3 738	1	(75)	(74)	0,00
BRC	01/2023	€	14 315		14 881	0	(403)	(403)	(0,01)
	01/2023	HUF	2 849 767		7 432	0	(163)	(163)	0,00
	01/2023	SGD	590		439	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	36	SGD	48	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	CAD	1 215	$	898	1	0	1	0,00
	01/2023	€	1 142 395		1 184 436	0	(35 305)	(35 305)	(0,39)
	01/2023	SEK	2 200		211	0	0	0	0,00
	01/2023	$	189	BRL	993	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		53 765	€	50 396	43	0	43	0,00
	03/2023		7 410	MXN	145 374	0	(53)	(53)	0,00
	05/2023	MXN	146	$	7	0	0	0	0,00
GLM	01/2023	BRL	993		191	3	0	3	0,00
	01/2023	CNH	92		13	0	0	0	0,00
	01/2023	$	639	PLN	3 238	99	0	99	0,00
	02/2023		190	BRL	993	0	(3)	(3)	0,00
	03/2023		2 963	MXN	60 920	120	0	120	0,00
	04/2023		1 072		21 572	13	0	13	0,00
JPM	01/2023		2 984	CAD	4 048	3	0	3	0,00
	01/2023		315	CNY	2 193	3	0	3	0,00
	02/2023	IDR	4 917 823	$	312	0	(6)	(6)	0,00
	02/2023	TWD	171		6	0	0	0	0,00
	03/2023	MXN	10		1	0	0	0	0,00
	03/2023	$	566	CNY	3 915	3	0	3	0,00
	03/2023		425	IDR	6 648 128	5	0	5	0,00
MBC	01/2023	CAD	4 960	$	3 698	37	0	37	0,00
	01/2023	€	52 153		54 677	0	(1 007)	(1 007)	(0,01)
	01/2023	£	8 249		10 054	129	0	129	0,00
	01/2023	NOK	2 045		209	1	0	1	0,00
	01/2023	$	1 020	CAD	1 370	0	(9)	(9)	0,00
	01/2023		86 507	€	81 449	457	0	457	0,01
	03/2023		258	IDR	4 035 070	3	0	3	0,00
	05/2023	CNH	189 447	$	28 229	583	0	583	0,01
MYI	01/2023	AUD	2 368		1 590	0	(16)	(16)	0,00
	01/2023	£	113		135	0	0	0	0,00
	01/2023	SGD	2		1	0	0	0	0,00
	01/2023	$	6 416	€	6 012	3	0	3	0,00
	01/2023		3 937	£	3 266	0	(8)	(8)	0,00
	02/2023	TWD	316	$	10	0	0	0	0,00
	03/2023	$	363	IDR	5 685 354	5	0	5	0,00
RBC	03/2023		3 594	MXN	71 874	48	0	48	0,00
	04/2023	MXN	216 585	$	10 449	0	(451)	(451)	(0,01)
SCX	01/2023	€	1 157 795		1 205 091	0	(31 094)	(31 094)	(0,36)
	01/2023	KRW	712 593		539	0	(27)	(27)	0,00
	01/2023	$	1 413	€	1 327	4	0	4	0,00
	02/2023	IDR	5 174 663	$	329	0	(6)	(6)	0,00
	02/2023	TWD	3 149		102	0	(1)	(1)	0,00
TOR	01/2023	£	296 876		356 930	0	(239)	(239)	0,00
UAG	01/2023	$	2 835	£	2 290	0	(80)	(80)	0,00
	02/2023	IDR	7 679 994	$	484	0	(13)	(13)	0,00
	05/2023	$	27 344	CNH	189 496	309	0	309	0,00
	09/2023		1 156	ZAR	20 273	11	0	11	0,00
						$ 1 886	$ (68 998)	$ (67 112)	(0,76)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Administrations en AUD (couverte) de Distribution et M Détail en AUD (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$ 8 405	AUD 12 477	$ 58	$ 0	$ 58	0,00
BOA	01/2023	AUD 143	$ 97	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 11	AUD 16	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	AUD 177	$ 120	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 876	AUD 1 291	4	(4)	0	0,00
MBC	01/2023	AUD 35	$ 24	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 4 882	AUD 7 248	40	(5)	35	0,00
MYI	01/2023	10 431	15 533	105	0	105	0,00
RBC	01/2023	1 696	2 529	20	0	20	0,00
TOR	01/2023	9 438	13 983	47	0	47	0,00
				$ 274	$ (9)	$ 265	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CAD (couverte) de Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	CAD 149	$ 109	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$ 62 990	CAD 85 170	0	(130)	(130)	0,00
CBK	01/2023	CAD 1 200	$ 889	3	0	3	0,00
	01/2023	$ 2	CAD 3	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	CAD 400	$ 293	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	$ 124 945	CAD 169 000	0	(213)	(213)	0,00
MYI	01/2023	CAD 2 203	$ 1 627	1	0	1	0,00
RBC	01/2023	605	445	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 3 397	CAD 4 601	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01/2023	30 842	41 434	0	(261)	(261)	0,00
TOR	01/2023	108 662	146 073	0	(851)	(851)	(0,01)
				$ 4	$ (1 460)	$ (1 456)	(0,01)

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de Capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de Distribution, E en CHF (couverte) de Capitalisation, W en CHF (couverte) de Capitalisation et W en CHF (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	CHF 13	$ 13	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$ 16 150	CHF 15 269	365	0	365	0,00
BRC	01/2023	CHF 36	$ 39	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	$ 28 040	CHF 26 488	608	0	608	0,01
MBC	01/2023	CHF 294	$ 317	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 16	CHF 15	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	16	15	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	CHF 51	$ 55	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 2 095	CHF 1 943	6	0	6	0,00
				$ 979	$ (1)	$ 978	0,01

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de Capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de Distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de Capitalisation, Investisseurs en EUR (couverte) de Distribution, Administrations en EUR (couverte) de Capitalisation, E en EUR (couverte) de Capitalisation, E en EUR (couverte) de Distribution, T en EUR (couverte) de Capitalisation, T en EUR (couverte) de Distribution, W en EUR (couverte) de Capitalisation et W en EUR (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€ 1 257	$ 1 326	$ 0	$ (16)	$ (16)	0,00
BPS	01/2023	1 185	1 263	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$ 2 107	€ 1 975	1	0	1	0,00
CBK	01/2023	€ 33 460	$ 35 625	0	(101)	(101)	0,00
	01/2023	$ 1 119 322	€ 1 079 099	32 840	0	32 840	0,38
MBC	01/2023	€ 30 003	$ 31 923	1	(113)	(112)	0,00
	01/2023	$ 1 383 231	€ 1 319 894	26 027	0	26 027	0,30
SCX	01/2023	1 237 236	1 188 679	31 923	0	31 923	0,36
TOR	01/2023	4 540	4 266	15	0	15	0,00
				$ 90 807	$ (232)	$ 90 575	1,04

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de Capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de Distribution, Administrations en GBP (couverte) de Distribution, W en GBP (couverte) de Capitalisation et W en GBP (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 4 775	$ 5 770	$ 25	$ 0	$ 25	0,00
	01/2023	$ 474	£ 389	0	(6)	(6)	0,00
BPS	01/2023	8	6	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	£ 3 225	$ 3 884	4	0	4	0,00
JPM	01/2023	$ 385 014	£ 318 846	0	(1 414)	(1 414)	(0,02)
MBC	01/2023	£ 14	$ 17	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 415 253	£ 345 618	1 490	(933)	557	0,01
MYI	01/2023	£ 29	$ 36	1	0	1	0,00
	01/2023	$ 8 202	£ 6 673	0	(174)	(174)	0,00
TOR	01/2023	383 502	318 976	256	0	256	0,00
UAG	01/2023	£ 529	$ 656	19	0	19	0,00
	01/2023	$ 145	£ 118	0	(3)	(3)	0,00
				$ 1 795	$ (2 530)	$ (735)	(0,01)

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Administrations en JPY (couverte) de Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 103	¥ 13 955	$ 3	$ 0	$ 3	0,00
BPS	01/2023	856	118 169	41	0	41	0,00
CBK	01/2023	26	3 429	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	1 247	171 085	50	0	50	0,00
SCX	01/2023	363	50 217	17	0	17	0,00
				$ 111	$ 0	$ 111	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en MXN (couverte) de Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 4 026	MXN 78 861	$ 20	$ 0	$ 20	0,00
BRC	01/2023	4 023	78 861	23	0	23	0,00
CBK	01/2023	MXN 91 626	$ 4 710	10	(1)	9	0,00
	01/2023	$ 3 147	MXN 61 994	34	0	34	0,00
	02/2023	4 624	90 396	0	(10)	(10)	0,00
GLM	01/2023	MXN 156 463	$ 7 992	9	(45)	(36)	0,00
	01/2023	$ 4 105	MXN 80 558	29	(1)	28	0,00
	02/2023	4 625	90 396	0	(10)	(10)	0,00
MBC	01/2023	MXN 2 654	$ 134	0	(2)	(2)	0,00
MYI	01/2023	$ 1 508	MXN 29 759	19	0	19	0,00
SCX	01/2023	MXN 90 396	$ 4 647	9	0	9	0,00
	02/2023	$ 4 624	MXN 90 396	0	(9)	(9)	0,00
UAG	01/2023	MXN 994	$ 51	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 626	MXN 12 098	0	(5)	(5)	0,00
	02/2023	51	994	0	0	0	0,00
				$ 153	$ (83)	$ 70	0,00

Au 31 décembre 2022, la Catégorie d'actions de capitalisation couverte en SEK et la Catégorie d'actions de capitalisation administrative couverte en SEK avaient en cours les contrats de change à terme suivants :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 156	SEK 1 607	$ 0	$ (2)	$ (2)	0,00
BRC	01/2023	4 908	51 399	27	0	27	0,00
CBK	01/2023	646	6 735	1	0	1	0,00
MYI	01/2023	1 332	14 015	13	0	13	0,00
UAG	01/2023	9 117	95 653	66	0	66	0,00
				$ 107	$ (2)	$ 105	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de Distribution, Administration en SGD (couverte) de Distribution, E en SGD (couverte) de Distribution et W en SGD (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 29 104	SGD 39 942	$ 682	$ 0	$ 682	0,01
BPS	01/2023	32 749	44 881	719	0	719	0,01
GLM	01/2023	SGD 124	$ 92	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 1 020	SGD 1 395	20	0	20	0,00
MBC	01/2023	SGD 1 442	$ 1 065	0	(11)	(11)	(0,01)
	01/2023	$ 30 080	SGD 41 126	589	0	589	0,01

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
UAG	01/2023	SGD 150	$110	$ 0	$ (2)	$ (2)	0,00
				$ 2 010	$ (14)	$ 1 996	0,02

Total des instruments financiers dérivés hors cote	**$ 23 288**	**0,27**
Total des investissements	**$ 9 225 432**	**105,41**
Autres actifs et passifs courants	**$ (473 636)**	**(5,41)**
Actifs nets	**$ 8 751 796**	**100,00**

ANNEXES À L'ÉTAT DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

µ La totalité ou une partie de ce montant représente des engagements de prêt non financés. Le taux d'intérêt pour la partie non financée sera déterminé au moment du financement.

(a) Titre à rémunération en nature.

(b) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(c) Titres à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement à échéance.

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

(f) Affilié au Fonds.

(g) Titre convertible conditionnel.

(h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,52 %) :

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Citigroup, Inc. 2,572 % échéance 03/06/2031	26/05/2020	$ 6 900	$ 5 596	0,06
Constellation Oil Services Holding S.A. « B »	10/06/2022	92	92	0,00
Corestate Capital Holding S.A. 8,000 % échéance 15/04/2023	06/12/2022	1 785	1 815	0,02
Deutsche Bank AG 3,035 % échéance 28/05/2032	25/05/2021 - 29/07/2021	1 123	836	0,01
Deutsche Bank AG 3,729 % échéance 14/01/2032	12/08/2022 - 16/08/2022	2 298	2 132	0,02
General Motors Co. 6,800 % échéance 01/10/2027	07/05/2020	1 697	1 767	0,02
Intelsat Emergence S.A.	01/05/2020 - 29/10/2021	16 083	4 419	0,05
		$ 29 978	$ 16 657	0,18

(i) Des titres d'une juste valeur globale de 6 805 $ (31 décembre 2021 : 80 181 $) et un montant en numéraire de 4 245 $ (31 décembre 2021 : 0 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 277 $ (31 décembre 2021 : 350 $) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 268 487 $ (31 décembre 2021 : 367 860 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 1 415 $) et un montant en numéraire de 9 202 $ (31 décembre 2021 : 18 540 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Mesures de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Titres cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 0	$ 6 595 189	$ 25 428	$ 6 620 617
Fonds d'investissement	609 289	267 341	0	876 630
Contrats de mise en pension	0	1 746 323	0	1 746 323
Instruments financiers dérivés[3]	69	(18 207)	0	(18 138)
Totaux	**$ 609 358**	**$ 8 590 646**	**$ 25 428**	**$ 9 225 432**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur les marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 5 994	$ 14 253 100	$ 14 925	$ 14 274 019
Fonds d'investissement	1 614 943	0	0	1 614 943
Contrats de mise en pension	0	157 316	0	157 316
Instruments financiers dérivés[3]	2 739	113 040	0	115 779
Totaux	**$ 1 623 676**	**$ 14 523 456**	**$ 14 925**	**$ 16 162 057**

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

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

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

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	En % de l'actif net
BRC	0,500 %	21/09/2022	TBD(1)	€ (3 442)	$ (3 673)	(0,04)
	0,800	21/09/2022	TBD(1)	(646)	(690)	(0,01)
JML	(0,400)	23/09/2022	TBD(1)	(2 148)	(2 283)	(0,03)
Total des contrats de prise en pension					**$ (6 646)**	**(0,08)**

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

Garantie (reçue)/nantie d'instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes(1)	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes(1)
AZD	$ 58	$ 0	$ 58	$ S/O	$ S/O	$ S/O
BOA	941	(920)	21	(453)	312	(141)
BPS	650	(800)	(150)	(31 423)	18 410	(13 013)
BRC	(2 633)	2 650	17	17 195	(9 560)	7 635
CBK	(1 931)	1 730	(201)	140	(212)	(72)
DUB	S/O	S/O	S/O	389	0	389
FBF	(104)	260	156	594	(550)	44
GLM	233	(250)	(17)	2 129	(4 240)	(2 111)
GST	(2 878)	2 952	74	3 647	(3 450)	197
HUS	S/O	S/O	S/O	1 227	(800)	427
JPM	2 534	(3 820)	(1 286)	8 772	(7 910)	862
MBC	27 060	(25 160)	1 900	S/O	S/O	S/O
MYC	(152)	260	108	502	(440)	62
MYI	(196)	260	64	15 617	(12 394)	3 223
RBC	(385)	430	45	1 228	130	1 358
SCX	561	(330)	231	38 828	(27 540)	11 288
SSB	S/O	S/O	S/O	(16)	0	(16)
TOR	(772)	660	(112)	23 126	(14 080)	9 046
UAG	302	0	302	(1 216)	1 103	(113)

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

Informations comparatives

Ce qui suit est une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières négociables admises à la cote sur une Bourse officielle	48,23	61,10
Valeurs mobilières négociables négociées sur un autre marché réglementé	25,74	23,45
Autres valeurs mobilières négociables	1,67	2,22
Fonds d'investissement	10,02	9,82
Contrats de mise en pension	19,95	0,96
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,32)	0,16
Instruments financiers dérivés compensés	(0,15)	0,06
Instruments financiers dérivés hors cote	0,27	0,49
Contrats de prise en pension	(0,08)	(0,50)

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Albanie	0,18	0,13
Argentine	0,52	0,53
Australie	0,07	0,05
Autriche	S/O	0,25
Bélarus	0,03	0,04
Bermudes	0,72	0,48
Brésil	0,00	0,60
Canada	0,29	0,24
Îles Caïmans	2,14	3,12
Chili	0,08	0,12
Chine	0,03	0,51
Colombie	0,42	0,40
Chypre	0,17	S/O
Danemark	0,14	S/O
République dominicaine	0,38	0,66
Équateur	0,25	0,24

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Égypte	0,56	0,61
Finlande	0,08	S/O
France	3,16	3,68
Allemagne	3,24	4,25
Ghana	0,06	0,10
Guernesey, Îles anglo-normandes	0,54	0,45
Hong Kong	0,98	1,06
Inde	0,02	0,04
Indonésie	0,60	1,86
Irlande	6,34	4,26
Île de Man	S/O	0,24
Israël	0,11	0,06
Italie	3,95	3,93
Côte d'Ivoire	0,12	0,27
Japon	0,92	0,71
Jersey, Îles anglo-normandes	1,02	0,65
Jordanie	S/O	0,07
Kazakhstan	S/O	0,01
Libéria	S/O	0,09
Luxembourg	3,92	4,24
Macédoine	0,08	0,05
Malaisie	S/O	0,01
Île Maurice	0,08	0,05
Mexique	1,79	2,39
Maroc	S/O	0,07
Multinational	0,33	0,50
Pays-Bas	3,82	3,83
Nigeria	0,41	0,31
Norvège	S/O	0,08
Oman	0,31	0,74
Panama	0,25	0,19
Paraguay	S/O	0,09
Pérou	S/O	0,26
Portugal	0,14	0,14
Qatar	0,12	0,83
Roumanie	0,07	0,22
Russie	0,29	0,53
Arabie saoudite	S/O	1,21
Serbie	0,07	0,07
Singapour	0,15	0,20
Slovénie	0,16	0,05
Afrique du Sud	0,09	0,47
Espagne	0,97	1,01
Sri Lanka	0,08	0,07
Supranational	S/O	0,05
Suède	0,37	0,01
Suisse	1,22	1,16
Tunisie	S/O	0,02
Turquie	0,70	1,27
Ukraine	0,22	0,57
Émirats arabes unis	0,13	0,59
Royaume-Uni	7,14	8,41
États-Unis	22,65	19,08
Venezuela	0,03	0,01
Îles Vierges britanniques	0,06	0,04
Instruments à court terme	2,87	8,24
Fonds d'investissement	10,02	9,82
Contrats de mise en pension	19,95	0,96
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,32)	0,16
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	(0,12)	0,03
Swaps de défaillance de crédit sur indices de crédit — vente de protection	0,18	(0,01)
Swaps de taux d'intérêt	(0,21)	0,04
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	(0,02)	0,08
Contrats de change à terme	(0,76)	(0,26)
Contrats de change à terme couverts	1,05	0,67
Autres actifs et passifs courants	(5,41)	1,74
Actifs nets	100,00	100,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES NÉGOCIABLES			
ARGENTINE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement argentin			
1,500 % éch. 09/07/2035	$ 1 252	$ 319	0,06
3,500 % éch. 09/07/2041	7 722	2 214	0,39
Provincia de Buenos Aires			
72,913 % éch. 12/04/2025 (a)	ARS 610	2	0,00
Total Argentine		2 535	0,45
BÉLARUS			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement de Biélorussie			
5,875 % éch. 24/02/2026 ^	$ 700	301	0,05
BERMUDES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Aircastle Ltd.			
2,850 % éch. 26/01/2028	1 100	901	0,16
5,250 % éch. 11/08/2025	2 250	2 166	0,38
Total Bermudes		3 067	0,54
BRÉSIL			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.			
0,000 % éch. 30/01/2023 (d)(f)	2 332	6	0,00
CANADA			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Air Canada Pass-Through Trust			
5,250 % éch. 01/10/2030	524	496	0,09
Fairfax Financial Holdings Ltd.			
2,750 % éch. 29/03/2028	€ 2 000	1 868	0,33
Total Canada		2 364	0,42
ÎLES CAÏMANS			
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS			
Vibrant CLO Ltd.			
5,283 % éch. 15/09/2030	$ 299	294	0,05
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Avolon Holdings Funding Ltd.			
2,125 % éch. 21/02/2026	500	431	0,08
2,528 % éch. 18/11/2027	1 627	1 303	0,23
3,250 % éch. 15/02/2027	300	257	0,05
Kaisa Group Holdings Ltd.			
9,375 % éch. 30/06/2024 ^	1 100	155	0,03
9,750 % éch. 28/09/2023 ^	3 000	422	0,07
10,500 % éch. 15/01/2025 ^	2 200	310	0,05
10,875 % éch. 23/07/2023 ^	400	56	0,01
11,250 % éch. 16/04/2025 ^	1 500	211	0,04
11,650 % éch. 01/06/2026 ^	1 000	141	0,03
11,700 % éch. 11/11/2025 ^	400	56	0,01
Lima Metro Line Finance Ltd.			
5,875 % éch. 05/07/2034	426	414	0,07
Melco Resorts Finance Ltd.			
4,875 % éch. 06/06/2025	700	644	0,11
5,375 % éch. 04/12/2029	500	402	0,07
Noble Finance Co. (11,000 % en numéraire ou 15,000 % de rémunération en nature)			
11,000 % éch. 15/02/2028 (b)	117	130	0,02
Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % en numéraire et 1,000 % en PIK)			
7,350 % éch. 01/12/2026 ^(b)	3 622	2 002	0,35
Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. (6,720 % en numéraire et 1,000 % en PIK)			
7,720 % éch. 01/12/2026 ^(b)	884	236	0,04
Park Aerospace Holdings Ltd.			
5,500 % éch. 15/02/2024	40	40	0,01
Sands China Ltd.			
3,750 % éch. 08/08/2031	900	710	0,13
Seagate HDD Cayman			
4,125 % éch. 15/01/2031	325	254	0,05
9,625 % éch. 01/12/2032	460	505	0,09
Seazen Group Ltd.			
4,450 % éch. 13/07/2025	1 000	705	0,12
6,000 % éch. 12/08/2024	200	157	0,03
Sunac China Holdings Ltd.			
5,950 % éch. 26/04/2024 ^	$ 900	$ 197	0,03
6,500 % éch. 09/07/2023 ^	700	155	0,03
6,650 % éch. 03/08/2024 ^	800	174	0,03
7,000 % éch. 09/07/2025 ^	1 000	219	0,04
7,250 % éch. 14/06/2022 ^	3 300	693	0,12
7,500 % éch. 01/02/2024 ^	900	200	0,04
7,950 % éch. 11/10/2023 ^	300	66	0,01
8,350 % éch. 19/04/2023 ^	200	44	0,01
Trafford Centre Finance Ltd.			
3,888 % éch. 28/07/2038	£ 300	315	0,06
		11 604	2,06
Total Îles Caïmans		11 898	2,11
CHILI			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
GNL Quintero S.A.			
4,634 % éch. 31/07/2029	494	478	0,09
CHINE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
New Metro Global Ltd.			
4,800 % éch. 15/12/2024	300	233	0,04
Yango Justice International Ltd.			
7,500 % éch. 15/04/2024 ^	2 600	95	0,02
7,500 % éch. 17/02/2025 ^	1 900	69	0,01
7,875 % éch. 04/09/2024 ^	1 900	69	0,01
Total Chine		466	0,08
COLOMBIE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement colombien			
5,000 % éch. 15/06/2045	3 300	2 257	0,40
CHYPRE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Atrium Finance PLC			
2,625 % éch. 05/09/2027	€ 1 300	973	0,17
DANEMARK			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
TDC Net A/S			
5,056 % éch. 31/05/2028	800	841	0,15
RÉPUBLIQUE DOMINICAINE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement de République Dominicaine			
6,500 % éch. 15/02/2048	$ 2 600	2 152	0,38
ÉQUATEUR			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement d'Équateur			
0,000 % éch. 31/07/2030 (d)	1 416	556	0,10
1,500 % éch. 31/07/2040	1 026	421	0,07
5,500 % éch. 31/07/2030	600	385	0,07
Total Équateur		1 362	0,24
ÉGYPTE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement égyptien			
5,625 % éch. 16/04/2030	€ 500	372	0,07
6,375 % éch. 11/04/2031	800	596	0,11
7,500 % éch. 16/02/2061	$ 3 000	1 862	0,33
8,500 % éch. 31/01/2047	700	469	0,08
Total Égypte		3 299	0,59
FINLANDE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Balder Finland Oyj			
1,375 % éch. 24/05/2030	€ 200	136	0,03
2,000 % éch. 18/01/2031	100	69	0,01
SBB Treasury Oyj			
0,750 % éch. 14/12/2028	400	275	0,05
Total Finlande		480	0,09
FRANCE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Altice France S.A.			
3,375 % éch. 15/01/2028	€ 100	$ 81	0,01
4,000 % éch. 15/07/2029	900	730	0,13
4,250 % éch. 15/10/2029	1 600	1 287	0,23
5,500 % éch. 15/10/2029	$ 1 600	1 223	0,22
BNP Paribas S.A.			
1,904 % éch. 30/09/2028	2 800	2 336	0,41
3,500 % éch. 16/11/2027	400	368	0,07
5,198 % éch. 10/01/2030	500	476	0,08
CGG S.A.			
8,750 % éch. 01/04/2027	3 100	2 483	0,44
Loxam S.A.S.			
2,875 % éch. 15/04/2026	€ 200	191	0,03
3,250 % éch. 14/01/2025	500	510	0,09
Renault S.A.			
2,375 % éch. 25/05/2026	3 600	3 467	0,61
TDF Infrastructure SASU			
1,750 % éch. 01/12/2029	3 600	2 925	0,52
Ubisoft Entertainment S.A.			
0,878 % éch. 24/11/2027	400	331	0,06
		16 408	2,90
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			
Casino Guichard-Perrachon S.A.			
5,340 % éch. 31/08/2025	2 600	2 361	0,42
Total France		18 769	3,32
ALLEMAGNE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
ADLER Real Estate AG			
2,125 % éch. 06/02/2024	100	95	0,02
3,000 % éch. 27/04/2026	400	298	0,05
Deutsche Bank AG			
1,750 % éch. 19/11/2030	3 600	3 026	0,54
3,547 % éch. 18/09/2031	$ 3 600	2 894	0,51
5,882 % éch. 08/07/2031	3 400	2 942	0,52
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide			
1,875 % éch. 31/03/2028	€ 1 500	1 383	0,25
IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % en numéraire ou 4,375 % en PIK)			
3,625 % éch. 15/05/2025 (b)	300	293	0,05
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % en numéraire ou 4,500 % en PIK)			
3,750 % éch. 15/09/2026 (b)	2 750	2 560	0,45
INEOS Styrolution Group GmbH			
2,250 % éch. 16/01/2027	2 400	2 092	0,37
ZF Finance GmbH			
2,750 % éch. 25/05/2027	1 200	1 082	0,19
3,750 % éch. 21/09/2028	3 100	2 790	0,50
Total Allemagne		19 455	3,45
GHANA			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement du Ghana			
8,125 % éch. 26/03/2032 ^	$ 400	147	0,03
8,750 % éch. 11/03/2061 ^	300	106	0,02
8,950 % éch. 26/03/2051 ^	200	72	0,01
Total Ghana		325	0,06
GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust			
5,250 % éch. 30/05/2025	13	13	0,00
Globalworth Real Estate Investments Ltd.			
3,000 % éch. 29/03/2025	€ 2 600	2 435	0,43
Total Guernesey, Îles anglo-normandes		2 448	0,43
HONG KONG			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Fortune Star BVI Ltd.			
3,950 % éch. 02/10/2026	3 600	2 209	0,39
Huarong Finance Co. Ltd.			
2,125 % éch. 30/09/2023	$ 2 800	2 695	0,48
5,824 % éch. 24/02/2023	1 200	1 196	0,21
Total Hong Kong		6 100	1,08

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
INDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Adani Electricity Mumbai Ltd.				
3,949 % éch. 12/02/2030	$	400	$ 306	0,05
INDONÉSIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				
1,875 % éch. 05/11/2031	€	500	386	0,07
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement indonésien				
1,100 % éch. 12/03/2033		2 000	1 568	0,28
1,400 % éch. 30/10/2031		700	585	0,10
			2 153	0,38
Total Indonésie			2 539	0,45
IRLANDE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Aurium CLO DAC				
2,108 % éch. 16/01/2031		300	313	0,05
Bain Capital Euro CLO DAC				
2,196 % éch. 20/01/2032		2 000	2 080	0,37
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				
2,356 % éch. 20/01/2032		200	206	0,04
Harvest CLO DAC				
2,228 % éch. 15/01/2032		2 500	2 586	0,46
Laurelin DAC				
2,176 % éch. 20/10/2031		1 100	1 138	0,20
Palmerston Park CLO DAC				
2,053 % éch. 18/04/2030		319	334	0,06
Sculptor European CLO DAC				
2,153 % éch. 14/01/2032		800	831	0,15
Toro European CLO DAC				
2,239 % éch. 12/01/2032		300	308	0,05
2,572 % éch. 15/02/2034		750	772	0,14
			8 568	1,52
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC				
2,700 % éch. 11/06/2023		2 800	209	0,04
Bank of Ireland Group PLC				
6,253 % éch. 16/09/2026	$	700	695	0,12
			904	0,16
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Setanta Aircraft Leasing DAC				
6,730 % éch. 05/11/2028		4 000	3 988	0,70
Total Irlande			13 460	2,38
ITALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Atlantia SpA				
1,625 % éch. 03/02/2025	€	300	300	0,05
1,875 % éch. 13/07/2027		300	273	0,05
1,875 % éch. 12/02/2028		5 000	4 449	0,79
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
2,625 % éch. 28/04/2025		3 600	3 487	0,62
8,000 % éch. 22/01/2030		2 700	2 529	0,45
Intesa Sanpaolo SpA				
5,148 % éch. 10/06/2030	£	100	98	0,02
5,500 % éch. 01/03/2028 (f)(h)	€	1 500	1 326	0,23
Nexi SpA				
2,125 % éch. 30/04/2029		2 600	2 259	0,40
UniCredit SpA				
7,296 % éch. 02/04/2034	$	1 700	1 561	0,27
7,830 % éch. 04/12/2023		7 100	7 175	1,27
Total Italie			23 457	4,15
JAPON				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nissan Motor Co. Ltd.				
4,345 % éch. 17/09/2027		6 700	6 086	1,08
4,810 % éch. 17/09/2030	$	200	$ 170	0,03
Total Japon			6 256	1,11
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AA Bond Co. Ltd.				
5,500 % éch. 31/07/2050	£	2 200	2 296	0,41
Adient Global Holdings Ltd.				
3,500 % éch. 15/08/2024	€	300	308	0,05
Corsair International Ltd.				
5,473 % éch. 28/01/2027		1 600	1 695	0,30
5,823 % éch. 28/01/2029		600	634	0,11
G City Europe Ltd.				
4,250 % éch. 11/09/2025		1 800	1 613	0,29
Total Jersey, Îles anglo-normandes			6 546	1,16

DESCRIPTION		ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
LUXEMBOURG				
ACTIONS ORDINAIRES				
Intelsat Emergence S.A. (c)(i)		14 398	346	0,06

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES				
Corestate Capital Holding S.A.				
1,375 % éch. 28/11/2049 ^	€	2 000	397	0,07
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
ADLER Group S.A.				
2,250 % éch. 27/04/2027		500	189	0,03
12,500 % éch. 31/07/2025 (i)		363	385	0,07
Albion Financing SARL				
5,250 % éch. 15/10/2026		1 300	1 217	0,22
6,125 % éch. 15/10/2026	$	500	447	0,08
Altice Financing S.A.				
5,750 % éch. 15/08/2029		6 000	4 731	0,84
Altice France Holding S.A.				
6,000 % éch. 15/02/2028		700	415	0,07
Aroundtown S.A.				
5,375 % éch. 21/03/2029		1 200	910	0,16
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature)				
3,000 % éch. 31/12/2026 (b)		144	85	0,02
Corestate Capital Holding S.A.				
3,500 % éch. 15/04/2023 ^	€	3 500	585	0,10
CPI Property Group S.A.				
1,500 % éch. 27/01/2031		1 000	619	0,11
1,625 % éch. 23/04/2027		800	610	0,11
1,750 % éch. 14/01/2030		1 400	912	0,16
2,750 % éch. 12/05/2026		100	84	0,02
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % éch. 19/11/2025		400	345	0,06
FEL Energy SARL				
5,750 % éch. 01/12/2040	$	3 696	3 168	0,56
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.				
4,250 % éch. 06/04/2024	£	1 900	1 601	0,28
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
6,500 % éch. 15/03/2030	$	1 072	961	0,17
Lincoln Financing SARL				
3,625 % éch. 01/04/2024	€	3 300	3 487	0,62
6,007 % éch. 01/04/2024		1 500	1 595	0,28
Logicor Financing SARL				
3,250 % éch. 13/11/2028		1 000	900	0,16
SIG Combibloc Purchase Co. SARL				
1,875 % éch. 18/06/2023		2 900	3 075	0,54
			26 321	4,66
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Albion Financing SARL				
6,752 % éch. 17/08/2026		2 000	2 094	0,37
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
7,445 % éch. 01/02/2029	$	279	270	0,05
			2 364	0,42

DESCRIPTION		ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
DROITS				
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05/12/2025		3 012	$ 21	0,01
Total Luxembourg			29 449	5,22

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
MACÉDOINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de Macédoine du nord				
2,750 % éch. 18/01/2025	€	300	300	0,05
ÎLE MAURICE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Greenko Solar Mauritius Ltd.				
5,550 % éch. 29/01/2025	$	800	755	0,13
MEXIQUE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Petroleos Mexicanos				
5,625 % éch. 23/01/2046		1 416	827	0,15
6,350 % éch. 12/02/2048		700	429	0,07
6,625 % éch. 15/06/2035		4 800	3 493	0,62
6,625 % éch. 15/06/2038		400	276	0,05
6,750 % éch. 21/09/2047		3 700	2 369	0,42
7,690 % éch. 23/01/2050		2 584	1 794	0,32
Trust Fibra Uno				
6,390 % éch. 15/01/2050		300	243	0,04
Total Mexique			9 431	1,67
MULTINATIONAL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Allied Universal Holdco LLC				
3,625 % éch. 01/06/2028	€	1 700	1 446	0,26
Connect Finco SARL				
6,750 % éch. 01/10/2026	$	1 000	929	0,16
Total Multinational			2 375	0,42
PAYS-BAS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
ASR Nederland NV				
7,000 % éch. 07/12/2043	€	100	107	0,02
Athora Netherlands NV				
7,000 % éch. 19/06/2025 (f)(h)		200	209	0,04
CTP NV				
0,500 % éch. 21/06/2025		100	90	0,02
1,500 % éch. 27/09/2031		100	64	0,01
Imperial Brands Finance Netherlands BV				
1,750 % éch. 18/03/2033		2 000	1 509	0,27
ING Groep NV				
5,750 % éch. 16/11/2026 (f)(h)	$	300	266	0,05
6,500 % éch. 16/04/2025 (f)(h)		1 300	1 232	0,22
6,750 % éch. 16/04/2024 (f)(h)		600	579	0,10
NE Property BV				
3,375 % éch. 14/07/2027	€	1 800	1 667	0,29
NN Group NV				
4,500 % éch. 15/01/2026 (f)		1 100	1 145	0,20
Q-Park Holding BV				
3,500 % éch. 01/02/2025		2 600	2 518	0,45
Syngenta Finance NV				
3,375 % éch. 16/04/2026		2 600	2 623	0,46
4,892 % éch. 24/04/2025	$	1 276	1 237	0,22
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV				
4,500 % éch. 01/03/2025	€	1 400	1 437	0,25
United Group BV				
5,250 % éch. 01/02/2030		600	464	0,08
Volkswagen International Finance NV				
3,500 % éch. 17/06/2025 (f)		900	891	0,16
ZF Europe Finance BV				
2,000 % éch. 23/02/2026		100	92	0,02
			16 130	2,86
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Sigma Bidco BV				
3,738 % éch. 02/07/2025		400	372	0,06

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
WP/AP Telecom Holdings BV					
6,202 % éch. 30/03/2029	€	5 700	$	5 864	1,04
				6 236	1,10
Total Pays-Bas				22 366	3,96
NIGERIA					
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement nigérian					
7,625 % éch. 28/11/2047	$	1 300		842	0,15
7,696 % éch. 23/02/2038		400		273	0,05
7,875 % éch. 16/02/2032		1 800		1 363	0,24
Total Nigeria				2 478	0,44
OMAN					
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement omanais					
6,750 % éch. 17/01/2048		1 600		1 504	0,27
QATAR					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Nakilat, Inc.					
6,067 % éch. 31/12/2033		1 196		1 236	0,22
ROUMANIE					
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement roumain					
2,000 % éch. 14/04/2033	€	600		412	0,07
2,875 % éch. 13/04/2042		600		360	0,07
Total Roumanie				772	0,14
RUSSIE					
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement russe					
4,250 % éch. 23/06/2027 ^	$	600		210	0,04
5,250 % éch. 23/06/2047 ^		1 600		592	0,10
Total Russie				802	0,14
SLOVÉNIE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.					
1,875 % éch. 27/01/2025	€	1 000		968	0,17
Nova Ljubljanska Banka d.d.					
3,400 % éch. 05/02/2030		600		532	0,10
Total Slovénie				1 500	0,27
AFRIQUE DU SUD					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
AngloGold Ashanti Holdings PLC					
3,750 % éch. 01/10/2030	$	200		174	0,03
Growthpoint Properties International Pty. Ltd.					
5,872 % éch. 02/05/2023		200		199	0,04
Total Afrique du Sud				373	0,07
ESPAGNE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.					
6,000 % éch. 15/01/2026 (f)(h)	€	800		816	0,14
6,138 % éch. 14/09/2028	$	600		602	0,11
Banco de Sabadell S.A.					
5,375 % éch. 08/09/2026	€	1 700		1 805	0,32
Lorca Telecom Bondco S.A.					
4,000 % éch. 18/09/2027		300		288	0,05
Total Espagne				3 511	0,62
SRI LANKA					
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement du Sri Lanka					
7,550 % éch. 28/03/2030 ^	$	1 000		319	0,06
7,850 % éch. 14/03/2029 ^		600		192	0,03
Total Sri Lanka				511	0,09

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
SUÈDE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Volvo Car AB					
4,250 % éch. 31/05/2028	€	2 000	$	1 967	0,35
SUISSE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Credit Suisse AG					
6,500 % éch. 08/08/2023 (h)	$	2 800		2 718	0,48
Credit Suisse Group AG					
4,282 % éch. 09/01/2028		700		581	0,10
Total Suisse				3 299	0,58
TURQUIE					
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement turc					
4,875 % éch. 16/04/2043		2 200		1 438	0,26
5,750 % éch. 11/05/2047		4 900		3 356	0,59
Total Turquie				4 794	0,85
UKRAINE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
NPC Ukrenergo					
6,875 % éch. 09/11/2028 ^		800		142	0,03
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement ukrainien					
4,375 % éch. 27/01/2032 ^(b)	€	4 400		874	0,15
6,750 % éch. 20/06/2028 (b)		200		40	0,01
8,994 % éch. 01/02/2026 (b)	$	300		68	0,01
				982	0,17
Total Ukraine				1 124	0,20
ÉMIRATS ARABES UNIS					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
DAE Sukuk Difc Ltd.					
3,750 % éch. 15/02/2026		900		856	0,15
ROYAUME-UNI					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Barclays PLC					
5,875 % éch. 15/09/2024 (f)(h)	£	200		221	0,04
7,750 % éch. 15/09/2023 (f)(h)	$	600		587	0,10
Bellis Acquisition Co. PLC					
3,250 % éch. 16/02/2026	£	3 800		3 736	0,66
Greene King Finance PLC					
5,106 % éch. 15/03/2034		276		293	0,05
HSBC Holdings PLC					
2,804 % éch. 24/05/2032	$	300		233	0,04
2,848 % éch. 04/06/2031		200		160	0,03
3,973 % éch. 22/05/2030		600		526	0,09
4,041 % éch. 13/03/2028		300		277	0,05
5,210 % éch. 11/08/2028		1 600		1 546	0,27
Jaguar Land Rover Automotive PLC					
5,875 % éch. 15/11/2024	€	1 000		1 010	0,18
John Lewis PLC					
4,250 % éch. 18/12/2034	£	400		293	0,05
6,125 % éch. 21/01/2025		300		347	0,06
Lloyds Banking Group PLC					
4,976 % éch. 11/08/2033	$	400		368	0,07
Market Bidco Finco PLC					
4,750 % éch. 04/11/2027	€	1 500		1 292	0,23
Marks & Spencer PLC					
4,500 % éch. 10/07/2027	£	1 000		1 036	0,18
Mitchells & Butlers Finance PLC					
3,972 % éch. 15/12/2030		210		228	0,04
5,219 % éch. 15/12/2030	$	839		778	0,14
6,469 % éch. 15/09/2032	£	332		364	0,06
NatWest Group PLC					
6,000 % éch. 29/12/2025 (f)(h)	$	1 700		1 574	0,28
Pinnacle Bidco PLC					
5,500 % éch. 15/02/2025	€	100		94	0,02
6,375 % éch. 15/02/2025	£	200		210	0,04

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Santander UK Group Holdings PLC					
3,823 % éch. 03/11/2028	$	1 500	$	1 343	0,24
6,750 % éch. 24/06/2024 (f)(h)	£	1 500		1 739	0,31
Virgin Media Secured Finance PLC					
4,250 % éch. 15/01/2030		2 300		2 159	0,38
Virgin Money UK PLC					
4,000 % éch. 03/09/2027		1 400		1 523	0,27
				21 937	3,88
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES					
Towd Point Mortgage Funding PLC					
4,071 % éch. 20/10/2051	£	1 972		2 358	0,42
Total Royaume-Uni				24 295	4,30
ÉTATS-UNIS					
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS					
Aames Mortgage Investment Trust					
5,169 % éch. 25/10/2035	$	120		117	0,02
5,216 % éch. 25/06/2035		88		87	0,02
Accredited Mortgage Loan Trust					
5,109 % éch. 25/09/2035		156		153	0,03
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust					
4,989 % éch. 25/02/2036		82		80	0,01
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					
4,478 % éch. 25/11/2032 ^		501		484	0,09
5,094 % éch. 25/11/2035		71		69	0,01
Argent Securities Trust					
4,709 % éch. 25/05/2036		576		146	0,03
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust					
5,019 % éch. 25/12/2035		36		36	0,01
5,394 % éch. 25/06/2035		517		493	0,09
6,189 % éch. 25/07/2034		21		20	0,00
Carrington Mortgage Loan Trust					
4,649 % éch. 25/02/2037		742		667	0,12
5,439 % éch. 25/05/2035		300		286	0,05
Countrywide Asset-Backed Certificates					
5,489 % éch. 25/05/2047 ^		816		621	0,11
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust					
3,209 % éch. 25/03/2036		77		75	0,01
4,569 % éch. 25/11/2047 ^		570		549	0,10
4,869 % éch. 25/02/2037 ^		1 600		1 379	0,24
4,914 % éch. 25/08/2036		2 100		2 000	0,34
5,229 % éch. 25/10/2047		2 003		1 932	0,34
5,439 % éch. 25/11/2034		77		76	0,01
5,964 % éch. 25/11/2034		144		143	0,03
Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.					
4,949 % éch. 25/04/2034		176		159	0,03
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.					
4,598 % éch. 25/01/2032		3		3	0,00
Ellington Loan Acquisition Trust					
5,439 % éch. 25/05/2037		343		326	0,06
First Franklin Mortgage Loan Trust					
5,664 % éch. 25/07/2034		163		158	0,03
Fremont Home Loan Trust					
4,929 % éch. 25/04/2036		291		252	0,04
5,319 % éch. 25/06/2035 ^		700		624	0,11
GSAA Home Equity Trust					
4,509 % éch. 25/11/2036		76		20	0,00
GSAMP Trust					
4,439 % éch. 25/12/2046		25		12	0,00
4,479 % éch. 25/01/2037		43		26	0,00
4,629 % éch. 25/08/2036		587		471	0,08
4,709 % éch. 25/05/2046		0		0	0,00
4,869 % éch. 25/06/2036		201		108	0,02
5,124 % éch. 25/09/2035 ^		84		82	0,01
Home Equity Asset Trust					
5,484 % éch. 25/05/2035		70		69	0,01
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust					
4,769 % éch. 25/06/2036		25		24	0,00
IXIS Real Estate Capital Trust					
5,019 % éch. 25/02/2036		6		7	0,00
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust					
3,773 % éch. 25/07/2036		178		173	0,03
4,579 % éch. 25/03/2047		110		108	0,02
4,649 % éch. 25/06/2037		85		85	0,02

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,689 % éch. 25/07/2036	$ 652	$ 299	0,05
4,689 % éch. 25/03/2037	400	375	0,07
Long Beach Mortgage Loan Trust			
4,929 % éch. 25/05/2046	557	189	0,03
4,989 % éch. 25/02/2036	910	749	0,13
MASTR Asset-Backed Securities Trust			
4,589 % éch. 25/08/2036	3 756	1 168	0,20
4,689 % éch. 25/03/2036	1 062	945	0,17
5,079 % éch. 25/03/2035	22	22	0,00
5,139 % éch. 25/12/2034 ^	13	12	0,00
5,169 % éch. 25/02/2034	482	457	0,08
5,289 % éch. 25/04/2034	100	96	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
4,529 % éch. 25/05/2037	208	146	0,03
4,709 % éch. 25/09/2036	238	108	0,02
4,969 % éch. 25/01/2035	560	552	0,10
5,094 % éch. 25/01/2035	290	267	0,05
6,289 % éch. 25/02/2047	127	111	0,02
Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust			
5,964 % éch. 25/11/2032	13	13	0,00
New Century Home Equity Loan Trust			
7,389 % éch. 25/01/2033 ^	199	169	0,03
NovaStar Mortgage Funding Trust			
4,549 % éch. 25/09/2037	254	251	0,04
Option One Mortgage Loan Trust			
4,609 % éch. 25/01/2037	260	155	0,03
5,124 % éch. 25/08/2035	87	86	0,02
Park Place Securities, Inc.			
5,094 % éch. 25/09/2035	44	45	0,01
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
5,439 % éch. 25/09/2034	26	25	0,00
6,189 % éch. 25/12/2034	473	457	0,08
Renaissance Home Equity Loan Trust			
5,340 % éch. 25/01/2037	1 336	440	0,08
Residential Asset Securities Corp. Trust			
4,471 % éch. 25/01/2034	34	34	0,01
5,079 % éch. 25/11/2035	128	126	0,02
5,094 % éch. 25/09/2035	665	619	0,11
Saxon Asset Securities Trust			
4,854 % éch. 25/03/2036	335	318	0,06
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
4,569 % éch. 25/07/2036	89	32	0,01
5,064 % éch. 25/01/2035	19	18	0,00
Soundview Home Loan Trust			
4,854 % éch. 25/06/2036 ^	4 814	4 119	0,73
Structured Asset Investment Loan Trust			
4,769 % éch. 25/03/2036	105	102	0,02
5,019 % éch. 25/11/2035	309	298	0,05
5,364 % éch. 25/10/2033	14	14	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
5,389 % éch. 25/08/2037	158	156	0,03
Structured Asset Securities Corp. Trust			
5,079 % éch. 25/09/2035	236	223	0,04
Truman Capital Mortgage Loan Trust			
4,649 % éch. 25/03/2036	543	536	0,10
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust			
4,539 % éch. 25/01/2037	177	152	0,03
		26 004	4,59

	ACTIONS		
ACTIONS ORDINAIRES			
ÉNERGIE			
Constellation Oil Services Holding S.A. « B » (c)(i)	161 700	18	0,00

	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
American Airlines Pass-Through Trust			
3,000 % éch. 15/04/2030	$ 72	63	0,01
3,150 % éch. 15/08/2033	86	72	0,01
3,200 % éch. 15/12/2029	576	500	0,09
3,350 % éch. 15/04/2031	227	196	0,03
3,375 % éch. 01/11/2028	375	314	0,06
3,575 % éch. 15/07/2029	286	256	0,05
3,650 % éch. 15/12/2029	72	56	0,01
3,650 % éch. 15/08/2030	220	196	0,03
3,700 % éch. 01/04/2028	$ 58	$ 50	0,01
American Tower Corp.			
3,950 % éch. 15/03/2029	700	647	0,11
Aviation Capital Group LLC			
3,500 % éch. 01/11/2027	600	525	0,09
5,500 % éch. 15/12/2024	800	786	0,14
BAT Capital Corp.			
3,557 % éch. 15/08/2027	100	92	0,02
Boeing Co.			
5,705 % éch. 01/05/2040	500	479	0,08
British Airways Pass-Through Trust			
4,250 % éch. 15/05/2034	107	96	0,02
Broadcom, Inc.			
3,137 % éch. 15/11/2035	108	80	0,01
3,187 % éch. 15/11/2036	1 015	732	0,13
CommScope, Inc.			
4,750 % éch. 01/09/2029	5 800	4 686	0,83
Community Health Systems, Inc.			
8,000 % éch. 15/03/2026	300	274	0,05
DAE Funding LLC			
3,375 % éch. 20/03/2028	600	533	0,09
Energy Transfer LP			
7,500 % éch. 01/07/2038	2 000	2 133	0,38
EnLink Midstream LLC			
5,375 % éch. 01/06/2029	300	278	0,05
EQT Corp.			
3,625 % éch. 15/05/2031	400	340	0,06
Ford Motor Credit Co. LLC			
1,744 % éch. 19/07/2024	€ 300	307	0,05
2,330 % éch. 25/11/2025	2 400	2 364	0,42
2,386 % éch. 17/02/2026	300	293	0,05
2,684 % éch. 01/12/2024	1 700	1 754	0,31
2,700 % éch. 10/08/2026	$ 700	609	0,11
3,021 % éch. 06/03/2024	€ 1 100	1 153	0,20
3,375 % éch. 13/11/2025	$ 300	272	0,05
5,584 % éch. 18/03/2024	600	593	0,10
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC			
5,500 % éch. 01/05/2028	1 400	1 196	0,21
6,500 % éch. 01/10/2025	1 237	1 165	0,21
Freedom Mortgage Corp.			
6,625 % éch. 15/01/2027	1 100	857	0,15
7,625 % éch. 01/05/2026	2 100	1 755	0,31
Global Atlantic Fin Co.			
4,400 % éch. 15/10/2029	1 000	839	0,15
GLP Capital LP			
5,750 % éch. 01/06/2028	300	296	0,05
GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC			
3,375 % éch. 24/03/2029	600	541	0,10
Kinder Morgan Energy Partners LP			
6,500 % éch. 01/02/2037	400	405	0,07
6,950 % éch. 15/01/2038	200	212	0,04
Las Vegas Sands Corp.			
3,200 % éch. 08/08/2024	500	473	0,08
3,500 % éch. 18/08/2026	600	542	0,10
3,900 % éch. 08/08/2029	300	253	0,04
Midwest Connector Capital Co. LLC			
3,900 % éch. 01/04/2024	100	97	0,02
MPT Operating Partnership LP			
3,692 % éch. 05/06/2028	£ 200	177	0,03
National Fuel Gas Co.			
5,200 % éch. 15/07/2025	$ 200	199	0,04
NGPL PipeCo LLC			
7,768 % éch. 15/12/2037	1 400	1 463	0,26
NuStar Logistics LP			
5,625 % éch. 28/04/2027	1 400	1 311	0,23
Organon & Co.			
2,875 % éch. 30/04/2028	€ 3 500	3 282	0,57
Pacific Gas & Electric Co.			
3,150 % éch. 01/01/2026	$ 400	372	0,07
3,300 % éch. 15/03/2027 ^	100	89	0,02
3,300 % éch. 01/08/2040	1 800	1 225	0,22
3,450 % éch. 01/07/2025	200	190	0,03
3,500 % éch. 15/06/2025 ^	100	94	0,02
3,750 % éch. 01/07/2028	200	178	0,03
4,450 % éch. 15/04/2042 ^	100	75	0,01
4,500 % éch. 01/07/2040	850	667	0,12
4,550 % éch. 01/07/2030	200	182	0,03
4,600 % éch. 15/06/2043 ^	$ 200	$ 152	0,03
4,650 % éch. 01/08/2028	300	276	0,05
Piper Sandler Cos.			
5,200 % éch. 15/10/2023	600	595	0,11
Plains All American Pipeline LP			
4,900 % éch. 15/02/2045	1 700	1 324	0,22
5,150 % éch. 01/06/2042	1 500	1 222	0,22
6,650 % éch. 15/01/2037	200	198	0,03
RLJ Lodging Trust LP			
3,750 % éch. 01/07/2026	200	178	0,03
Rockies Express Pipeline LLC			
4,800 % éch. 15/05/2030	700	617	0,11
4,950 % éch. 15/07/2029	300	270	0,05
Southern California Edison Co.			
4,000 % éch. 01/04/2047	200	157	0,03
Spirit AeroSystems, Inc.			
9,375 % éch. 30/11/2029	100	105	0,02
Standard Industries, Inc.			
2,250 % éch. 21/11/2026	€ 2 200	2 018	0,35
T-Mobile USA, Inc.			
2,550 % éch. 15/02/2031	$ 400	328	0,06
Tallgrass Energy Partners LP			
5,500 % éch. 15/01/2028	500	444	0,08
6,000 % éch. 31/12/2030	300	260	0,05
Time Warner Cable LLC			
5,875 % éch. 15/11/2040	500	438	0,08
U.S. Airways Pass-Through Trust			
3,950 % éch. 15/05/2027	178	162	0,03
United Airlines Pass-Through Trust			
2,900 % éch. 01/11/2029	88	71	0,01
3,450 % éch. 01/06/2029	137	122	0,02
3,450 % éch. 07/01/2030	147	124	0,02
3,500 % éch. 01/09/2031	162	140	0,02
4,150 % éch. 11/10/2025	266	258	0,05
5,875 % éch. 15/04/2029	2 608	2 575	0,46
VICI Properties LP			
3,500 % éch. 15/02/2025	200	189	0,03
Wynn Resorts Finance LLC			
5,125 % éch. 01/10/2029	1 000	859	0,15
		51 946	9,17

CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			
Adient U.S. LLC			
7,634 % éch. 10/04/2028	394	391	0,07
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC			
6,603 % éch. 01/12/2027	2 156	2 155	0,38
CenturyLink, Inc.			
6,634 % éch. 15/03/2027	3 954	3 762	0,67
Charter Communications Operating LLC			
6,140 % éch. 01/02/2027	5 215	5 100	0,90
CommScope, Inc.			
7,634 % éch. 06/04/2026	484	457	0,08
Hilton Domestic Operating Co., Inc.			
6,173 % éch. 22/06/2026	4 185	4 177	0,74
Level 3 Financing, Inc.			
6,134 % éch. 01/03/2027	3 226	3 100	0,55
Standard Industries, Inc.			
6,425 % éch. 22/09/2028	1 324	1 309	0,23
		20 451	3,62

TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES			
Banc of America Alternative Loan Trust			
4,789 % éch. 25/01/2037 ^	90	69	0,01
Banc of America Funding Trust			
4,273 % éch. 20/01/2047 ^	44	40	0,01
BCAP LLC Trust			
6,250 % éch. 26/08/2036	1 940	960	0,17
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
6,800 % éch. 25/02/2036	6	6	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust			
2,960 % éch. 25/10/2046 ^	22	19	0,00
5,410 % éch. 25/10/2035	68	63	0,01
Countrywide Alternative Loan Trust			
3,528 % éch. 25/01/2036	11	10	0,00
4,773 % éch. 20/05/2046 ^	291	240	0,04
4,789 % éch. 25/07/2036 ^	3	2	0,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,889 % éch. 25/04/2036	$ 563	$ 210	0,04
6,000 % éch. 25/05/2036 ^	140	76	0,01
6,000 % éch. 25/02/2037 ^	860	422	0,08
6,000 % éch. 25/04/2037 ^	202	118	0,02
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
3,008 % éch. 25/04/2046 ^	17	5	0,00
3,537 % éch. 25/03/2037 ^	9	7	0,00
4,929 % éch. 25/04/2046	1 715	499	0,09
6,000 % éch. 25/12/2036 ^	342	157	0,03
6,000 % éch. 25/07/2037	66	28	0,01
6,500 % éch. 25/11/2036 ^	107	42	0,01
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
6,500 % éch. 25/04/2033	0	0	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates			
2,746 % éch. 26/04/2038	80	77	0,01
3,635 % éch. 27/09/2035	101	84	0,02
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust			
4,267 % éch. 25/09/2035	12	11	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust			
4,779 % éch. 19/05/2035	150	134	0,02
4,819 % éch. 19/06/2035	3	3	0,00
4,893 % éch. 20/10/2045	319	281	0,05
4,959 % éch. 19/11/2035	7	5	0,00
HSI Asset Securitization Corp. Trust			
4,829 % éch. 25/11/2035	1 488	1 381	0,25
IndyMac Mortgage Loan Trust			
2,824 % éch. 25/06/2037 ^	11	9	0,00
3,644 % éch. 25/12/2036 ^	2	2	0,00
4,749 % éch. 25/07/2047	56	39	0,01
Lehman Mortgage Trust			
6,000 % éch. 25/09/2037 ^	104	95	0,02
Luminent Mortgage Trust			
4,789 % éch. 25/10/2046	711	616	0,11
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
3,455 % éch. 25/05/2036	4	3	0,00
4,676 % éch. 25/11/2029	1	1	0,00
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
3,665 % éch. 25/03/2036 ^	35	24	0,00
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust			
4,038 % éch. 25/08/2035	1	1	0,00
Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
4,789 % éch. 25/05/2047	62	54	0,01
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
4,829 % éch. 25/06/2037	227	193	0,03
Structured Asset Mortgage Investments Trust			
4,789 % éch. 25/05/2036	459	351	0,06
4,809 % éch. 25/09/2047 ^	581	464	0,08
SunTrust Alternative Loan Trust			
5,039 % éch. 25/12/2035 ^	$ 2	$ 2	0,00
Thornburg Mortgage Securities Trust			
5,639 % éch. 25/06/2037 ^	11	10	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
3,248 % éch. 25/11/2042	7	6	0,00
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
4,051 % éch. 25/09/2036 ^	128	37	0,01
		6 856	1,21
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Uniform Mortgage-Backed Security			
5,500 % éch. 01/12/2052	994	998	0,18
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
5,000 % éch. 01/01/2053	10 100	9 954	1,79
5,500 % éch. 01/02/2053	9 400	9 421	1,70
		20 373	3,67
Total États-Unis		125 648	22,26
VENEZUELA			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Petroleos de Venezuela S.A.			
6,000 % éch. 16/05/2024 ^	1 600	82	0,02
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement vénézuélien			
6,000 % éch. 09/12/2020 ^	241	17	0,00
7,000 % éch. 31/03/2038 ^	1 528	137	0,02
7,750 % éch. 13/10/2019 ^	1 900	152	0,03
		306	0,05
Total Venezuela		388	0,07
ÎLES VIERGES BRITANNIQUES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Champion Path Holdings Ltd.			
4,500 % éch. 27/01/2026	500	437	0,08
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BILLETS À COURT TERME			
Corestate Capital Holding S.A.			
8,000 % éch. 15/04/2023 (i)	€ 200	214	0,04
Federal Home Loan Bank			
4,340 % éch. 10/02/2023	$ 5 300	5 300	0,94
4,345 % éch. 23/02/2023	5 100	5 100	0,90
4,345 % éch. 06/03/2023	$ 10 100	$ 10 101	1,79
		20 715	3,67
BONS DU TRÉSOR HONGROIS			
18,250 % éch. 03/01/2023 (d)(e)	HUF 217 000	578	0,10
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
4,050 % éch. 26/01/2023 (d)(e)	$ 3 300	3 292	0,58
4,065 % éch. 26/01/2023 (d)(e)	4 700	4 688	0,83
		7 980	1,41
Total instruments à court terme		29 273	5,18
Total des valeurs mobilières		**$ 401 584**	**71,13**

ACTIONS

FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Asia Strategic Interest Bond Fund (g)	250 000	2 200	0,39
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)	651 264	5 946	1,05
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO European High Yield Bond Fonds (g)	538 168	5 675	1,00
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds US Short-Term Fund (g)	3 564 234	35 571	6,30
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	588 919	5 862	1,04
		55 254	9,78
FONDS INDICIELS COTÉS			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)	5 570	552	0,10
Total Fonds d'investissement		**$ 55 806**	**9,88**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux directeur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Accords de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
FICC	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 2 432	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 29/06/2023	$ (2 481)	$ 2 432	$ 2 432	0,43
	4,280	30/12/2022	03/01/2023	100 400	Obligations du Trésor américain 0,250 % - 3,000 % échéance 30/06/2025 - 15/07/2025	(102 408)	100 400	100 448	17,78
Total des contrats de mise en pension						**$ (104 889)**	**$ 102 832**	**$ 102 880**	**18,21**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	À découvert	03/2023	372	$ 1 174	0,21
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Longue	03/2023	12	(61)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars	À découvert	03/2023	335	476	0,08
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Longue	03/2023	21	(165)	(0,03)
				$ 1 424	0,25
Total des instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé				**$ 1 424**	**0,25**

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant du notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AT&T, Inc.	1,000 %	20/06/2026	$ 2 200	$ (37)	(0,01)
Auchan Holding S.A.	1,000	20/12/2027	€ 200	(7)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2026	$ 500	(5)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2027	1 000	(2)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	6 100	(15)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2026	600	(4)	0,00
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20/12/2025	€ 3 300	(367)	(0,06)
Glencore Finance Europe Ltd.	5,000	20/12/2027	2 200	(285)	(0,05)
Marks & Spencer PLC	1,000	20/12/2024	4 100	108	0,02
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2024	4 000	(84)	(0,02)
				$ (698)	(0,12)

SWAPS DE DÉFAILLANCE DE CRÉDIT SUR INDICES DE CRÉDIT – VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant du notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.EM-34 à 5 ans	1,000 %	20/12/2025	$ 3 864	$ (16)	0,00
Indice CDX.EM-36 à 5 ans	1,000	20/12/2026	22 816	242	0,04
Indice CDX.EM-37 à 5 ans	1,000	20/06/2027	294	9	0,00
Indice CDX.EM-38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	5 800	146	0,03
Indice CDX.HY-38 à 5 ans	5,000	20/06/2027	2 277	115	0,02
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000	20/12/2027	17 100	446	0,08
Indice CDX.IG-37 à 5 ans	1,000	20/12/2026	900	(2)	0,00
Indice CDX.IG-38 à 5 ans	1,000	20/06/2027	19 800	136	0,02
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000	20/12/2027	33 300	233	0,04
				$ 1 309	0,23

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir[3]	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	2,250 %	15/03/2028	£ 15 200	$ 538	0,10
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,050	15/12/2031	¥ 940 000	225	0,04
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2027	$ 74 000	920	0,16
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	14 400	(153)	(0,03)
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2052	14 000	124	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,000	16/12/2030	22 300	4 293	0,75
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	17/06/2025	33 800	4 104	0,73
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053	€ 6 100	366	0,07
					$ 10 417	1,84
Total des instruments financiers dérivés compensés					**$ 11 028**	**1,95**

(1) Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(2) Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, tel que défini par les termes de ce contrat de swap précis.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Voir note 2, Transactions sur titres et revenus sur investissements, dans les Notes relatives aux États financiers pour plus d'informations.

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

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

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant du notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente – Indice hors cote iTraxx Europe 37 à 5 ans	Vente	3,000 %	15/03/2023	1 500	$ (3)	$ 0	0,00

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant du notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BRC	Obligation internationale du gouvernement indonésien	1,000 %	20/06/2031	$ 5 500	$ (236)	$ 49	$ (187)	(0,03)
GST	ADLER Real Estate AG	5,000	20/12/2026	€ 700	(5)	(174)	(179)	(0,03)
JPM	Hochtief AG	5,000	20/12/2026	2 700	643	(330)	313	0,05
					$ 402	$ (455)	$ (53)	(0,01)

(1) Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(2) Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, tel que défini par les termes de ce contrat de swap précis.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€	871	$	919	$ 0	$ (11)	$ (11)	0,00
	01/2023	$	834	£	675	0	(22)	(22)	0,00
	02/2023		79	ZAR	1 445	6	0	6	0,00
BPS	01/2023	HUF	34 553	$	90	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$	757	€	710	1	0	1	0,00
	03/2023		5 206	MXN	104 931	105	0	105	0,02
BRC	01/2023	€	2 614	$	2 717	0	(74)	(74)	(0,01)
	01/2023	HUF	181 615		474	0	(10)	(10)	0,00
CBK	01/2023	BRL	2 883		549	3	0	3	0,00
	01/2023	$	4 591	€	4 308	8	0	8	0,00
	03/2023		35	MXN	689	0	0	0	0,00
GLM	01/2023		541	BRL	2 883	5	0	5	0,00
	03/2023	MXN	103 972	$	5 058	0	(204)	(204)	(0,04)
	04/2023	BRL	2 883		531	0	(5)	(5)	0,00
JPM	01/2023	£	16 649		20 104	74	0	74	0,01
	01/2023	$	43	CNY	300	0	0	0	0,00
	03/2023		77		535	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	€	131 486	$	137 804	0	(2 585)	(2 585)	(0,46)
	01/2023	¥	119 600		878	0	(29)	(29)	(0,01)
	01/2023	$	5 689	€	5 353	26	0	26	0,01
	01/2023		817	¥	110 600	22	0	22	0,00
	05/2023	CNH	16 100	$	2 399	50	0	50	0,01
MYI	01/2023	AUD	132		88	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	€	4		5	0	0	0	0,00
	01/2023	£	288		354	7	0	7	0,00
	01/2023	$	554	€	519	0	0	0	0,00
	01/2023		870	£	722	0	(2)	(2)	0,00
UAG	02/2023	IDR	387 962	$	24	0	(1)	(1)	0,00
	05/2023	$	2 324	CNH	16 104	26	0	26	0,01
						$ 333	$ (2 946)	$ (2 613)	(0,46)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de Capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de Distribution II, Classe E en EUR (couverte) de Capitalisation et Classe E en EUR (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	€	7 979	$	8 506	$ 0	$ (14)	$ (14)	0,00
BOA	01/2023		388		409	0	(5)	(5)	0,00
BPS	01/2023		30		32	0	0	0	0,00
	01/2023	$	84	€	78	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	€	1 490	$	1 577	0	(14)	(14)	(0,01)
	01/2023	$	55 559	€	53 571	1 639	0	1 639	0,29
MBC	01/2023	€	1 099	$	1 169	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	$	71 820	€	68 417	1 231	0	1 231	0,22
SCX	01/2023		59 966		57 613	1 547	0	1 547	0,27
						$ 4 417	$ (37)	$ 4 380	0,77

Tableau des investissements Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de Capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 89	$ 108	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	01/2023	$ 2	£ 2	0	0	0	0,00
BPS	01/2023	£ 4	$ 5	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	722	869	1	0	1	0,00
JPM	01/2023	$ 98 171	£ 81 299	0	(360)	(360)	(0,06)
MBC	01/2023	£ 3	$ 3	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 98 435	£ 82 047	392	(118)	274	0,05
MYI	01/2023	13	11	0	0	0	0,00
TOR	01/2023	97 725	81 283	65	0	65	0,01
UAG	01/2023	£ 32	$ 39	1	0	1	0,00
	01/2023	$ 7	£ 6	0	0	0	0,00
				$ 460	$ (478)	$ (18)	0,00

Total des instruments financiers dérivés hors cote	**$ 1 696**	**0,30**
Total des investissements	**$ 574 370**	**101,72**
Autres actifs et passifs courants	**$ (9 686)**	**(1,72)**
Actifs nets	**$ 564 684**	**100,00**

ANNEXES À L'ÉTAT DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est une obligation Interest Only (« IO ») ou une obligation zéro-coupon (IO Strip).

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(d) Titres à coupon zéro.

(e) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

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

(g) Affilié au Fonds.

(h) Titre convertible conditionnel.

(i) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,10 %) :

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
ADLER Group S.A.	22/12/2022	$ 385	$ 385	0,07
Constellation Oil Services Holding S.A. « B »	06/10/2022	18	18	0,00
Corestate Capital Holding S.A. 8,000 % échéance 15/04/2023	06/12/2022	210	214	0,04
Intelsat Emergence S.A.	24/02/2020 - 01/05/2020	1 289	346	0,06
		$ 1 517	$ 578	0,17

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 4 551 $) et un montant en numéraire de 0 $ (31 décembre 2021 : 64 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 2 760 $) et un montant en numéraire de 1 278 $ (31 décembre 2021 : 0 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Un montant en numéraire de 19 045 $ (31 décembre 2021 : 46 051 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 0	$ 399 799	$ 1 785	$ 401 584
Fonds d'investissement	55 254	552	0	55 806
Contrats de mise en pension	0	102 832	0	102 832
Instruments financiers dérivés[3]	1 425	12 723	0	14 148
Totaux	**$ 56 679**	**$ 515 906**	**$ 1 785**	**$ 574 370**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 1 027	$ 1 091 334	$ 1 166	$ 1 093 527
Fonds d'investissement	126 929	0	0	126 929
Contrats de mise en pension	0	58 930	0	58 930
Instruments financiers dérivés[3]	802	29 107	0	29 909
Totaux	**$ 128 758**	**$ 1 179 371**	**$ 1 166**	**$ 1 309 295**

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

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

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ (14)	$ 0	$ (14)	$ S/O	$ S/O	$ S/O
BOA	(31)	0	(31)	(483)	332	(151)
BPS	104	0	104	6 091	(4 920)	1 171
BRC	(270)	208	(62)	(189)	272	83
CBK	1 636	(1 510)	126	(22)	0	(22)
DUB	S/O	S/O	S/O	34	0	34
GLM	(204)	270	66	(1 312)	1 053	(259)
GST	(179)	0	(179)	(15)	0	(15)
HUS	S/O	S/O	S/O	(1 286)	1 103	(183)
JPM	27	(80)	(53)	1 210	(1 030)	180
MBC	(1 015)	800	(215)	S/O	S/O	S/O
MYC	S/O	S/O	S/O	(1)	0	(1)
MYI	4	(28)	(24)	6	0	6
RBC	S/O	S/O	S/O	1 320	(860)	460
SCX	1 547	(1 450)	97	2 595	(2 620)	(25)
SSB	S/O	S/O	S/O	(6)	0	(6)
TOR	65	(120)	(55)	1 452	(1 140)	312
UAG	26	0	26	3 614	(2 420)	1 194

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	38,87	52,28
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	30,57	28,84
Autres valeurs mobilières	1,69	2,65
Fonds d'investissement	9,88	9,72
Contrats de mise en pension	18,21	4,51
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,25	0,06
Instruments financiers dérivés compensés	1,95	1,24
Instruments financiers dérivés hors cote	0,30	1,00
Contrats de prise en pension	S/O	(0,37)

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Albanie	S/O	0,07
Argentine	0,45	0,63
Australie	S/O	0,04
Autriche	S/O	0,27
Biélorussie	0,05	0,05
Bermudes	0,54	0,52
Brésil	0,00	0,45
Canada	0,42	0,32
Îles Caïmans	2,11	3,02
Chili	0,09	0,14
Chine	0,08	0,37
Colombie	0,40	0,47
Chypre	0,17	S/O
Danemark	0,15	S/O
République dominicaine	0,38	0,62
Équateur	0,24	0,27
Égypte	0,59	0,72

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Finlande	0,09	S/O
France	3,32	3,85
Allemagne	3,45	2,93
Ghana	0,06	0,12
Guernesey, Îles Anglo-Normandes	0,43	0,53
Hong Kong	1,08	1,33
Inde	0,05	0,03
Indonésie	0,45	1,49
Irlande	2,38	3,35
Île de Man	S/O	0,29
Israël	S/O	0,07
Italie	4,15	4,64
Côte d'Ivoire	S/O	0,28
Japon	1,11	0,86
Jersey, Îles Anglo-Normandes	1,16	0,47
Jordanie	S/O	0,06
Liberia	S/O	0,11
Luxembourg	5,22	4,89
Macédoine du Nord	0,05	0,06
Île Maurice	0,13	0,11
Mexique	1,67	2,03
Maroc	S/O	0,03
Multinationales	0,42	0,54
Pays-Bas	3,96	3,48
Nigeria	0,44	0,38
Oman	0,27	0,58
Panama	S/O	0,16
Pérou	S/O	0,26
Qatar	0,22	1,05
Roumanie	0,14	0,29
Russie	0,14	S/O
Arabie saoudite	S/O	1,07
Serbie	S/O	0,07
Slovénie	0,27	0,06
Afrique du Sud	0,07	0,38
Espagne	0,62	0,36
Sri Lanka	0,09	0,09
Supranationales	S/O	0,06
Suède	0,35	0,03
Suisse	0,58	1,16
Tunisie	S/O	0,03
Turquie	0,85	1,26
Ukraine	0,20	0,60
Émirats arabes unis	0,15	0,30
Royaume-Uni	4,30	7,12
États-Unis	22,26	19,04
Venezuela	0,07	0,02
Îles Vierges britanniques	0,08	0,04
Instruments à court terme	5,18	9,85
Fonds d'investissement	9,88	9,72
Contrats de mise en pension	18,21	4,51
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,25	0,06
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,12)	0,03
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,23	(0,01)
Swaps de taux d'intérêt	1,84	1,22
OTC Financial Derivative Instruments		
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,01)	0,03
Contrats de change à terme	(0,46)	(0,31)
Contrats de change à terme couverts	0,77	1,28
Autres actifs et passifs à court terme	(1,72)	(0,30)
Actif net	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
ARGENTINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement argentin 3,500 % éch. 09/07/2041	$	200	$ 57	0,58
BRÉSIL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco BTG Pactual S.A. 2,750 % éch. 11/01/2026		200	182	1,85
Natura Cosmeticos S.A. 4,125 % éch. 03/05/2028		200	164	1,65
Total Brésil			346	3,50
CANADA				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Air Canada Pass-Through Trust 5,250 % éch. 01/10/2030		75	71	0,72
ÎLES CAÏMANS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % éch. 18/11/2027		100	80	0,81
2,875 % éch. 15/02/2025		100	93	0,94
Total Îles Caïmans			173	1,75
CHILI				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement chilien 3,100 % éch. 07/05/2041		200	144	1,46
COLOMBIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement colombien 5,000 % éch. 15/06/2045		200	137	1,39
DANEMARK				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
TDC Net A/S 5,056 % éch. 31/05/2028	€	100	105	1,07
RÉPUBLIQUE DOMINICAINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 6,500 % éch. 15/02/2048	$	200	166	1,68
ÉQUATEUR				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement d'Équateur 2,500 % éch. 31/07/2035		100	46	0,47
FINLANDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nokia Oyj 3,125 % éch. 15/05/2028	€	100	101	1,03
FRANCE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Accor S.A. 2,375 % éch. 29/11/2028		100	92	0,93
BNP Paribas S.A. 1,675 % éch. 30/06/2027	$	200	174	1,77
Crown European Holdings S.A. 2,875 % éch. 01/02/2026	€	100	102	1,04
Faurecia SE 2,375 % éch. 15/06/2029		100	81	0,82
Verallia S.A. 1,625 % éch. 14/05/2028		100	92	0,93
Vilmorin & Cie S.A. 1,375 % éch. 26/03/2028		100	79	0,80
Total France			620	6,29
ALLEMAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Deutsche Bank AG 1,625 % éch. 20/01/2027	€	100	$ 94	0,96
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,875 % éch. 31/03/2028		100	92	0,93
Schaeffler AG 3,375 % éch. 12/10/2028		100	93	0,95
ZF Finance GmbH 2,000 % éch. 06/05/2027		100	88	0,89
Total Allemagne			367	3,73
GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Globalworth Real Estate Investments Ltd. 3,000 % éch. 29/03/2025		100	94	0,95
INDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % éch. 05/03/2027	$	200	192	1,95
IRLANDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % éch. 18/01/2033	£	100	122	1,24
ITALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nexi SpA 2,125 % éch. 30/04/2029	€	100	87	0,88
CÔTE D'IVOIRE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 6,625 % éch. 22/03/2048		100	76	0,77
JAPON				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,472 % éch. 14/01/2029	$	200	169	1,71
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
G City Europe Ltd. 4,250 % éch. 11/09/2025	€	100	90	0,91
LUXEMBOURG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Altice Financing S.A. 4,250 % éch. 15/08/2029		100	86	0,87
Lincoln Financing SARL 3,625 % éch. 01/04/2024		100	106	1,08
Total Luxembourg			192	1,95
MEXIQUE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,750 % éch. 12/10/2110	$	100	85	0,86
MAROC				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement marocain 4,000 % éch. 15/12/2050		200	138	1,40
MULTI-PAYS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
NXP BV 5,350 % éch. 01/03/2026		100	100	1,01
MULTINATIONALES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
American Airlines, Inc. 5,500 % éch. 20/04/2026	$	50	$ 48	0,49
PAYS-BAS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Citycon Treasury BV 1,625 % éch. 12/03/2028	€	100	78	0,79
CTP NV 1,250 % éch. 21/06/2029		100	71	0,72
NE Property BV 3,375 % éch. 14/07/2027		100	93	0,94
Total Pays-Bas			242	2,45
OMAN				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement omanais 6,750 % éch. 17/01/2048	$	200	188	1,91
PANAMA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement panaméen 6,700 % éch. 26/01/2036		100	105	1,06
PÉROU				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement péruvien 3,300 % éch. 11/03/2041		100	73	0,74
ROUMANIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement roumain 1,750 % éch. 13/07/2030	€	100	75	0,76
SINGAPOUR				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Flex Ltd. 4,875 % éch. 15/06/2029	$	100	94	0,96
ESPAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Abertis Infraestructuras S.A. 3,375 % éch. 27/11/2026	£	100	109	1,11
Banco de Sabadell S.A. 0,875 % éch. 16/06/2028	€	100	86	0,87
CaixaBank S.A. 3,750 % éch. 07/09/2029		100	105	1,07
Cellnex Finance Co. S.A. 2,000 % éch. 15/09/2032		100	79	0,80
Total Espagne			379	3,85
SUÈDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
EQT AB 0,875 % éch. 14/05/2031		100	74	0,75
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % éch. 16/02/2026	£	100	98	1,00
Berkeley Group PLC 2,500 % éch. 11/08/2031		100	81	0,82
HSBC Holdings PLC 3,973 % éch. 22/05/2030	$	200	175	1,78
Marks & Spencer PLC 4,500 % éch. 10/07/2027	£	100	104	1,06
NatWest Group PLC 0,780 % éch. 26/02/2030	€	100	84	0,85
Virgin Media Secured Finance PLC 4,125 % éch. 15/08/2030	£	100	92	0,93
Vodafone Group PLC 5,125 % éch. 04/06/2081	$	100	73	0,74
Total Royaume-Uni			707	7,18

Tableau des investissements Fonds Diversified Income ESG Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÉTATS-UNIS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Ally Financial, Inc. 8,000 % éch. 01/11/2031	$ 100	$ 103	1,06
Aviation Capital Group LLC 5,500 % éch. 15/12/2024	100	98	1,00
Ball Corp. 2,875 % éch. 15/08/2030	100	80	0,81
Boise Cascade Co. 4,875 % éch. 01/07/2030	100	88	0,89
CCO Holdings LLC 4,250 % éch. 01/02/2031	100	81	0,82
Clearway Energy Operating LLC 3,750 % éch. 15/02/2031	100	83	0,84
CommScope Technologies LLC 6,000 % éch. 15/06/2025	100	91	0,92
Crocs, Inc. 4,250 % éch. 15/03/2029	100	85	0,86
Dana, Inc. 4,250 % éch. 01/09/2030	100	81	0,82
DaVita, Inc. 4,625 % éch. 01/06/2030	50	40	0,41
Dell International LLC 6,020 % éch. 15/06/2026	100	102	1,04
Edgewell Personal Care Co. 5,500 % éch. 01/06/2028	100	94	0,96
Global Medical Response, Inc. 6,500 % éch. 01/10/2025	$ 100	$ 72	0,73
HAT Holdings LLC 3,375 % éch. 15/06/2026	100	87	0,88
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,625 % éch. 15/02/2032	100	80	0,81
Ingevity Corp. 3,875 % éch. 01/11/2028	100	86	0,87
Level 3 Financing, Inc. 3,625 % éch. 15/01/2029	100	73	0,74
LPL Holdings, Inc. 4,000 % éch. 15/03/2029	100	87	0,88
Microsoft Corp. 2,675 % éch. 01/06/2060	100	64	0,65
MSCI, Inc. 3,625 % éch. 01/09/2030	50	42	0,43
SBA Communications Corp. 3,125 % éch. 01/02/2029	100	83	0,84
Southern California Edison Co. 2,500 % éch. 01/06/2031	100	83	0,84
T-Mobile USA, Inc. 2,250 % éch. 15/02/2026	100	91	0,92
United Airlines Pass-Through Trust 5,875 % éch. 15/04/2029	79	78	0,79
VMware, Inc. 4,500 % éch. 15/05/2025	100	98	1,00
Wells Fargo & Co. 4,540 % éch. 15/08/2026	$ 100	$ 98	1,00
		2 148	**21,81**
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
5,000 % éch. 01/02/2053	200	197	2,00
5,500 % éch. 01/02/2053	200	201	2,04
		398	**4,04**
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Obligations du Trésor américain			
4,000 % éch. 15/11/2042	175	171	1,74
Total États-Unis		2 717	27,59
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BONS DU TRÉSOR HONGROIS			
18,250 % éch. 03/01/2023 (a)(b)	HUF 4 000	11	0,11
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
4,290 % éch. 09/03/2023 (a)(b)	$ 1 400	1 389	14,10
4,397 % éch. 23/03/2023 (a)(b)	200	198	2,01
		1 587	**16,11**
Total des Instruments à court terme		1 598	16,22
Total des Valeurs mobilières		**$ 9 978**	**101,26**

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars	Long	03/2023	1	$ (1)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Court	03/2023	6	23	0,23
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars	Court	03/2023	1	1	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Long	03/2023	1	0	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	6	(4)	(0,04)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	5	(4)	(0,04)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Long	03/2023	1	1	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Long	03/2023	3	(1)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Court	03/2023	2	16	0,16
				$ 31	0,31
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ 31**	**0,31**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000 %	15/03/2033	£ 95	$ 2	0,02
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053	30	(1)	(0,01)
À recevoir	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250	15/03/2028	150	5	0,05
À recevoir	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,500	15/03/2025	150	2	0,02
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	15/06/2032	¥ 10 000	2	0,02
					$ 10	0,10
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ 10**	**0,10**

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

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

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€ 19	$ 20	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	£ 522	628	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 114	€ 108	1	0	1	0,01
BRC	01/2023	CAD 4	$ 3	0	0	0	0,00
	01/2023	£ 3	4	0	0	0	0,00
	01/2023	HUF 3 348	9	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 7	€ 7	0	0	0	0,00
	01/2023	10	£ 8	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	€ 66	$ 69	0	(1)	(1)	(0,01)
MYI	01/2023	$ 11	€ 10	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	€ 2 258	$ 2 350	0	(60)	(60)	(0,61)
	01/2023	$ 4	€ 4	0	0	0	0,00
				$ 1	$ (61)	$ (60)	(0,61)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 2	€ 2	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
CBK	01/2023	90	87	2	0	2	0,03
GLM	01/2023	72	69	2	0	2	0,02
SCX	01/2023	82	78	2	0	2	0,02
				$ 6	$ 0	$ 6	0,07

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 75	£ 63	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BRC	01/2023	2	2	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	76	62	0	(1)	(1)	(0,01)
SCX	01/2023	75	63	1	0	1	0,01
				$ 1	$ (1)	$ 0	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ (54)**	**(0,54)**
Total des Investissements	**$ 9 965**	**101,13**
Autres actifs et passifs à court terme	**$ (111)**	**(1,13)**
Actif net	**$ 9 854**	**100,00**

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

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

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

Un montant en numéraire de 113 $ a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 9 978	$ 0	$ 9 978
Instruments financiers dérivés[3]	41	(54)	0	(13)
Totaux	**$ 41**	**$ 9 924**	**$ 0**	**$ 9 965**

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

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

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

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

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

	Au 31 décembre 2022		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ 1	$ 0	$ 1
GLM	2	0	2
SCX	(57)	0	(57)

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)[1]
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	61,68	S/O
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	39,58	S/O
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,31	S/O
Instruments financiers dérivés compensés	0,10	S/O
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,54)	S/O

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

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Adient U.S. LLC				
7,634 % éch. 10/04/2028	$	1 576	$ 1 562	0,04
American Airlines, Inc.				
8,993 % éch. 20/04/2028		900	898	0,03
At Home Group, Inc.				
7,993 % éch. 24/07/2028		1 287	1 019	0,03
BCP Modular Services Holdings Ltd.				
6,702 % éch. 15/12/2028	€	4 900	4 892	0,14
Caesars Resort Collection LLC				
7,134 % éch. 23/12/2024	$	3 386	3 383	0,10
7,884 % éch. 21/07/2025		3 643	3 638	0,10
Carnival Corp.				
7,384 % éch. 30/06/2025		2 632	2 531	0,07
CenturyLink, Inc.				
6,634 % éch. 15/03/2027		1 074	1 022	0,03
Charter Communications Operating LLC				
6,140 % éch. 01/02/2027		188	184	0,01
Delos Finance SARL				
6,480 % éch. 06/10/2023		3 220	3 219	0,09
Hertz Corp.				
7,630 % éch. 30/06/2028		2 807	2 757	0,08
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
6,173 % éch. 22/06/2026		4 774	4 764	0,14
Hilton Grand Vacations Borrower LLC				
7,384 % éch. 02/08/2028		1 580	1 572	0,05
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
7,445 % éch. 01/02/2029		366	354	0,01
IRB Holding Corp.				
7,134 % éch. 05/02/2025		4 036	4 006	0,11
7,317 % éch. 15/12/2027		1 818	1 767	0,05
MPH Acquisition Holdings LLC				
8,985 % éch. 01/09/2028		4 444	3 816	0,11
Organon & Co.				
7,750 % éch. 02/06/2028		2 793	2 772	0,08
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				
8,165 % éch. 16/11/2025		4 479	4 234	0,12
Starfruit Finco BV				
5,052 % éch. 01/10/2025	€	5 476	5 590	0,16
U.S. Foods, Inc.				
7,134 % éch. 22/11/2028	$	4 394	4 382	0,13
United Airlines, Inc.				
8,108 % éch. 21/04/2028		1 474	1 459	0,04
Zayo Group Holdings, Inc.				
5,148 % éch. 09/03/2027	€	1 945	1 662	0,05
7,384 % éch. 09/03/2027	$	6 204	5 053	0,14
			66 536	1,91
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				
ABN AMRO Bank NV				
4,375 % éch. 22/09/2025 (g)(i)	€	700	691	0,02
Acef Holding S.C.A.				
1,250 % éch. 26/04/2030		2 000	1 474	0,04
ADLER Group S.A.				
2,250 % éch. 27/04/2027		4 300	1 625	0,05
12,500 % éch. 31/07/2025 (j)		3 121	3 308	0,10
AerCap Ireland Capital DAC				
2,450 % éch. 29/10/2026	$	500	438	0,01
3,000 % éch. 29/10/2028		200	168	0,00
3,650 % éch. 21/07/2027		1 350	1 222	0,04
4,450 % éch. 01/10/2025		2 850	2 743	0,08
4,450 % éch. 03/04/2026		2 300	2 198	0,06
AGFC Capital Trust				
5,829 % éch. 15/01/2067		2 500	1 402	0,04
Aircastle Ltd.				
2,850 % éch. 26/01/2028		1 500	1 229	0,04
Altarea S.C.A.				
1,750 % éch. 16/01/2030	€	1 800	1 433	0,04
1,875 % éch. 17/01/2028		1 700	1 412	0,04
AMCO - Asset Management Co. SpA				
1,500 % éch. 17/07/2023		1 800	1 903	0,05
2,250 % éch. 17/07/2027		2 600	2 495	0,07
American Tower Corp.				
0,400 % éch. 15/02/2027	€	3 100	$ 2 831	0,08
2,300 % éch. 15/09/2031	$	300	234	0,01
Annington Funding PLC				
2,308 % éch. 06/10/2032	£	1 000	867	0,03
Antares Holdings LP				
3,950 % éch. 15/07/2026	$	1 600	1 386	0,04
Aroundtown S.A.				
0,375 % éch. 15/04/2027	€	1 100	779	0,02
5,375 % éch. 21/03/2029	$	16 200	12 281	0,35
Atrium Finance PLC				
2,625 % éch. 05/09/2027	€	5 200	3 890	0,11
Aviation Capital Group LLC				
3,500 % éch. 01/11/2027	$	3 600	3 150	0,09
3,875 % éch. 01/05/2023		300	298	0,01
5,500 % éch. 15/12/2024		200	197	0,01
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % éch. 18/11/2027		4 290	3 435	0,10
Balder Finland Oyj				
1,000 % éch. 18/01/2027	€	1 800	1 438	0,04
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
3,625 % éch. 24/09/2024		400	406	0,01
Banco Santander S.A.				
4,375 % éch. 14/01/2026 (g)(i)		3 200	2 912	0,08
5,147 % éch. 18/08/2025	$	4 400	4 356	0,13
Bank of America Corp.				
2,687 % éch. 22/04/2032		200	161	0,00
3,550 % éch. 05/03/2024		2 200	2 192	0,06
3,864 % éch. 23/07/2024		5 300	5 253	0,15
4,125 % éch. 22/01/2024		5 050	5 009	0,14
4,300 % éch. 28/01/2025 (g)		3 600	3 135	0,09
Bank of Ireland Group PLC				
7,500 % éch. 19/05/2025 (g)(i)	€	3 700	3 848	0,11
Barclays PLC				
2,645 % éch. 24/06/2031	$	900	704	0,02
3,330 % éch. 24/11/2042		3 600	2 470	0,07
3,375 % éch. 02/04/2025	€	1 100	1 163	0,03
4,337 % éch. 10/01/2028	$	300	279	0,01
4,972 % éch. 16/05/2029		300	282	0,01
5,304 % éch. 09/08/2026		2 500	2 484	0,07
5,501 % éch. 09/08/2028		600	582	0,02
6,375 % éch. 15/12/2025 (g)(i)	£	1 700	1 880	0,05
7,125 % éch. 15/06/2025 (g)(i)		900	1 026	0,03
7,250 % éch. 15/03/2023 (g)(i)		2 700	3 218	0,09
7,385 % éch. 02/11/2028	$	2 500	2 610	0,08
7,437 % éch. 02/11/2033		2 700	2 837	0,08
7,750 % éch. 15/09/2023 (g)(i)		800	783	0,02
8,000 % éch. 15/06/2024 (g)(i)		400	390	0,01
Bevco Lux SARL				
1,000 % éch. 16/01/2030	€	4 400	3 539	0,10
BGC Partners, Inc.				
4,375 % éch. 15/12/2025	$	1 100	1 032	0,03
Blue Owl Finance LLC				
3,125 % éch. 10/06/2031		4 500	3 352	0,10
BNP Paribas S.A.				
1,904 % éch. 30/09/2028		7 800	6 507	0,19
2,000 % éch. 13/09/2036	£	2 100	1 673	0,05
2,125 % éch. 23/01/2027	€	2 400	2 394	0,07
4,400 % éch. 14/08/2028	$	4 800	4 547	0,13
BPCE S.A.				
2,125 % éch. 13/10/2046 (i)	€	3 800	2 841	0,08
Brown & Brown, Inc.				
4,200 % éch. 15/09/2024	$	7 500	7 365	0,21
CaixaBank S.A.				
6,750 % éch. 13/06/2024 (g)(i)	€	1 000	1 044	0,03
CapitaLand Ascendas REIT				
0,750 % éch. 23/06/2028		3 200	2 676	0,08
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund				
0,500 % éch. 27/01/2028		2 000	1 654	0,05
0,900 % éch. 12/10/2029		2 300	1 793	0,05
Cooperatieve Rabobank UA				
4,375 % éch. 29/06/2027 (g)(i)		1 800	1 715	0,05
Coventry Building Society				
2,625 % éch. 07/12/2026		1 100	1 135	0,03
CPI Property Group S.A.				
1,500 % éch. 27/01/2031		5 400	3 345	0,10
1,625 % éch. 23/04/2027		6 650	5 070	0,15
1,750 % éch. 14/01/2030	€	100	$ 65	0,00
2,750 % éch. 12/05/2026		1 100	925	0,03
2,750 % éch. 22/01/2028	£	5 950	4 794	0,14
4,875 % éch. 16/07/2025 (g)	€	2 200	1 196	0,03
Credit Suisse AG				
0,250 % éch. 01/09/2028		3 700	2 864	0,08
6,500 % éch. 08/08/2023 (i)	$	5 500	5 339	0,15
Credit Suisse Group AG				
2,125 % éch. 12/09/2025	£	500	536	0,02
3,869 % éch. 12/01/2029	$	4 750	3 814	0,11
4,194 % éch. 01/04/2031		1 000	778	0,02
4,550 % éch. 17/04/2026		1 200	1 060	0,03
5,250 % éch. 11/02/2027 (g)(i)		800	523	0,02
6,250 % éch. 18/12/2024 (g)(i)		500	394	0,01
6,375 % éch. 21/08/2026 (g)(i)		1 000	719	0,02
6,442 % éch. 11/08/2028		4 750	4 333	0,12
7,500 % éch. 17/07/2023 (g)(i)		3 000	2 404	0,07
7,500 % éch. 11/12/2023 (g)(i)		5 200	4 555	0,13
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % éch. 19/11/2025	€	3 100	2 675	0,08
Crown Castle, Inc.				
3,100 % éch. 15/11/2029	$	250	218	0,01
3,800 % éch. 15/02/2028		2 250	2 095	0,06
CTP NV				
0,625 % éch. 27/09/2026	€	1 800	1 481	0,04
1,250 % éch. 21/06/2029		5 100	3 629	0,10
1,500 % éch. 27/09/2031		1 700	1 091	0,03
Deutsche Bank AG				
0,898 % éch. 28/05/2024 (j)	$	1 900	1 778	0,05
1,375 % éch. 17/02/2032	€	4 600	3 583	0,10
1,625 % éch. 20/01/2027		1 900	1 791	0,05
2,625 % éch. 16/12/2024	£	1 200	1 342	0,04
3,035 % éch. 28/05/2032 (j)	$	800	608	0,02
3,742 % éch. 07/01/2033		1 200	855	0,02
3,875 % éch. 12/02/2024	£	3 500	4 110	0,12
6,119 % éch. 14/07/2026	$	8 902	8 851	0,25
Digital Dutch Finco BV				
1,500 % éch. 15/03/2030	€	1 100	921	0,03
Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust				
5,250 % éch. 30/05/2025	$	13	13	0,00
DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH				
2,500 % éch. 25/01/2027	€	3 500	2 800	0,08
EQT AB				
2,375 % éch. 06/04/2028		1 200	1 128	0,03
Equinix, Inc.				
0,250 % éch. 15/03/2027		1 500	1 387	0,04
3,900 % éch. 15/04/2032	$	300	267	0,01
Erste Group Bank AG				
6,500 % éch. 15/04/2024 (g)(i)	€	200	209	0,01
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
4,625 % éch. 29/04/2030	$	2 500	2 274	0,07
Ford Motor Credit Co. LLC				
2,330 % éch. 25/11/2025	€	200	197	0,01
2,700 % éch. 10/08/2026	$	3 900	3 392	0,10
2,748 % éch. 14/06/2024	£	2 300	2 622	0,08
2,900 % éch. 16/02/2028	$	1 800	1 489	0,04
3,021 % éch. 06/03/2024	€	900	944	0,03
3,250 % éch. 15/09/2025		100	102	0,00
4,535 % éch. 06/03/2025	£	200	229	0,01
G City Europe Ltd.				
4,250 % éch. 11/09/2025	€	1 200	1 076	0,03
Globalworth Real Estate Investments Ltd.				
2,950 % éch. 29/07/2026		1 300	1 105	0,03
3,000 % éch. 29/03/2025		3 100	2 904	0,08
Goldman Sachs Group, Inc.				
0,673 % éch. 08/03/2024	$	1 500	1 484	0,04
1,000 % éch. 16/12/2025	£	2 500	2 770	0,08
1,875 % éch. 16/12/2030		2 500	2 307	0,07
2,615 % éch. 22/04/2032	$	200	160	0,00
3,000 % éch. 15/03/2024		1 500	1 463	0,04
3,615 % éch. 15/03/2028		2 000	1 866	0,05
3,691 % éch. 05/06/2028		300	279	0,01
3,750 % éch. 22/05/2025		400	387	0,01
5,776 % éch. 15/05/2026		800	795	0,02
Hamburg Commercial Bank AG				
0,500 % éch. 22/09/2026	€	2 800	2 542	0,07
HSBC Holdings PLC				
1,750 % éch. 24/07/2027	£	3 200	3 314	0,10

Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
2,357 % éch. 18/08/2031	$	2 200	$ 1 686	0,05
2,804 % éch. 24/05/2032		800	621	0,02
2,871 % éch. 22/11/2032		5 000	3 833	0,11
3,973 % éch. 22/05/2030		4 700	4 123	0,12
4,300 % éch. 08/03/2026		700	678	0,02
4,583 % éch. 19/06/2029		4 170	3 847	0,11
4,750 % éch. 04/07/2029 (g)(i)	€	2 200	2 022	0,06
5,210 % éch. 11/08/2028	$	2 600	2 513	0,07
5,674 % éch. 18/05/2024		2 300	2 291	0,07
6,375 % éch. 30/03/2025 (g)(i)		500	485	0,01
Huarong Finance Co. Ltd.				
3,375 % éch. 24/02/2030		900	687	0,02
3,625 % éch. 30/09/2030		2 600	1 995	0,06
3,875 % éch. 13/11/2029		2 300	1 820	0,05
4,250 % éch. 07/11/2027		500	428	0,01
4,500 % éch. 29/05/2029		1 700	1 413	0,04
4,750 % éch. 27/04/2027		1 300	1 136	0,03
4,950 % éch. 07/11/2047		1 200	825	0,02
Hyundai Capital Services, Inc.				
0,750 % éch. 15/09/2023		3 500	3 366	0,10
ING Groep NV				
5,750 % éch. 16/11/2026 (g)(i)		900	799	0,02
Intesa Sanpaolo SpA				
0,750 % éch. 16/03/2028	€	3 100	2 758	0,08
3,250 % éch. 23/09/2024	$	5 800	5 505	0,16
4,000 % éch. 23/09/2029		400	343	0,01
5,148 % éch. 10/06/2030	£	1 400	1 376	0,04
JAB Holdings BV				
2,200 % éch. 23/11/2030	$	4 900	3 685	0,11
JPMorgan Chase & Co.				
2,595 % éch. 24/02/2026		6 400	6 022	0,17
3,220 % éch. 01/03/2025		3 050	2 966	0,09
4,005 % éch. 23/04/2029		4 500	4 171	0,12
Kennedy-Wilson, Inc.				
4,750 % éch. 01/02/2030		3 000	2 291	0,07
Lazard Group LLC				
4,375 % éch. 11/03/2029		15 300	14 162	0,41
Legal & General Group PLC				
5,625 % éch. 24/03/2031 (g)(i)	£	800	831	0,02
LFS Topco LLC				
5,875 % éch. 15/10/2026	$	1 500	1 212	0,03
Lloyds Banking Group PLC				
4,375 % éch. 22/03/2028		900	856	0,02
4,947 % éch. 27/06/2025 (g)(i)	€	1 100	1 127	0,03
4,976 % éch. 11/08/2033	$	2 900	2 671	0,08
Logicor Financing SARL				
0,625 % éch. 17/11/2025	€	300	274	0,01
1,500 % éch. 13/07/2026		2 300	2 079	0,06
1,625 % éch. 17/01/2030		900	702	0,02
2,000 % éch. 17/01/2034		1 000	679	0,02
2,750 % éch. 15/01/2030	£	900	826	0,02
Mitsubishi HC Capital, Inc.				
3,960 % éch. 19/09/2023	$	600	593	0,02
Mizuho Financial Group, Inc.				
0,470 % éch. 06/09/2029	€	3 000	2 576	0,07
2,564 % éch. 13/09/2031	$	1 600	1 223	0,04
Morgan Stanley				
0,000 % éch. 02/04/2032 (j)		3 600	2 056	0,06
3,875 % éch. 29/04/2024		2 575	2 536	0,07
Morgan Stanley Domestic Holdings, Inc.				
4,500 % éch. 20/06/2028		7 500	7 307	0,21
MPT Operating Partnership LP				
2,500 % éch. 24/03/2026	£	2 500	2 396	0,07
Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal				
0,625 % éch. 21/06/2027	€	1 200	1 058	0,03
2,125 % éch. 21/06/2052		3 400	2 467	0,07
Nationwide Building Society				
3,766 % éch. 08/03/2024	$	3 500	3 481	0,10
3,960 % éch. 18/07/2030		900	781	0,02
4,302 % éch. 08/03/2029		6 800	6 147	0,18
4,363 % éch. 01/08/2024		2 000	1 974	0,06
5,875 % éch. 20/12/2024 (g)(i)	£	1 600	1 822	0,05
NatWest Group PLC				
2,000 % éch. 04/03/2025	€	4 500	4 686	0,13
4,519 % éch. 25/06/2024	$	7 200	7 134	0,21
4,892 % éch. 18/05/2029		1 700	1 612	0,05
5,125 % éch. 12/05/2027 (g)(i)	£	200	203	0,01
6,274 % éch. 25/06/2024	$	900	900	0,03
NatWest Markets PLC				
1,000 % éch. 28/05/2024	€	1 700	$ 1 751	0,05
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
1,850 % éch. 16/09/2026	$	1 600	1 338	0,04
2,000 % éch. 09/03/2026		1 400	1 205	0,03
2,450 % éch. 15/09/2028		700	545	0,02
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % éch. 05/02/2030	€	2 500	2 214	0,06
3,650 % éch. 19/11/2029		2 900	2 600	0,07
Nuveen Finance LLC				
4,125 % éch. 01/11/2024	$	500	487	0,01
Ohio National Financial Services, Inc.				
5,800 % éch. 24/01/2030		3 500	3 224	0,09
OneMain Finance Corp.				
5,625 % éch. 15/03/2023		350	349	0,01
6,125 % éch. 15/03/2024		2 650	2 569	0,07
Owl Rock Capital Corp.				
2,875 % éch. 11/06/2028		1 900	1 495	0,04
Park Aerospace Holdings Ltd.				
4,500 % éch. 15/03/2023		2 900	2 893	0,08
5,500 % éch. 15/02/2024		28	28	0,00
Piper Sandler Cos.				
5,200 % éch. 15/10/2023		3 600	3 568	0,10
PRA Group, Inc.				
7,375 % éch. 01/09/2025		1 100	1 071	0,03
Prologis International Funding S.A.				
3,125 % éch. 01/06/2031	€	2 200	2 092	0,06
RLJ Lodging Trust LP				
3,750 % éch. 01/07/2026	$	1 600	1 427	0,04
Sagax AB				
1,125 % éch. 30/01/2027	€	3 800	3 285	0,09
2,000 % éch. 17/01/2024		800	819	0,02
2,250 % éch. 13/03/2025		2 200	2 169	0,06
Sagax Euro MTN NL BV				
0,750 % éch. 26/01/2028		2 200	1 769	0,05
1,000 % éch. 17/05/2029		1 200	901	0,03
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB				
1,000 % éch. 12/08/2027		1 400	1 045	0,03
Santander UK Group Holdings PLC				
3,823 % éch. 03/11/2028	$	3 100	2 775	0,08
4,796 % éch. 15/11/2024		8 800	8 655	0,25
6,750 % éch. 24/06/2024 (g)(i)	£	400	464	0,01
SELP Finance SARL				
3,750 % éch. 10/08/2027	€	3 300	3 282	0,09
Sirius Real Estate Ltd.				
1,125 % éch. 22/06/2026		4 800	4 008	0,12
Société Générale S.A.				
4,677 % éch. 15/06/2027	$	3 700	3 603	0,10
Sofina S.A.				
1,000 % éch. 23/09/2028	€	2 900	2 420	0,07
Spirit Realty LP				
4,000 % éch. 15/07/2029	$	400	348	0,01
Stichting AK Rabobank Certificaten				
6,500 % (g)	€	1 996	2 049	0,06
STORE Capital Corp.				
4,625 % éch. 15/03/2029	$	200	180	0,01
Synchrony Financial				
4,500 % éch. 23/07/2025		800	768	0,02
5,150 % éch. 19/03/2029		9 000	8 535	0,25
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % éch. 18/11/2028	£	1 200	1 064	0,03
5,250 % éch. 29/05/2026		3 500	3 898	0,11
UBS Group AG				
4,375 % éch. 10/02/2031 (g)(i)	$	1 300	991	0,03
4,703 % éch. 05/08/2027		1 400	1 355	0,04
UniCredit SpA				
2,569 % éch. 22/09/2026		350	310	0,01
6,625 % éch. 03/06/2023 (g)(i)	€	2 000	2 069	0,06
7,830 % éch. 04/12/2023	$	12 000	12 127	0,35
Ursa Re Ltd.				
8,277 % éch. 07/12/2027		6 000	5 896	0,17
VICI Properties LP				
3,500 % éch. 15/02/2025		1 700	1 606	0,05
3,750 % éch. 15/02/2027		3 300	3 001	0,09
4,125 % éch. 15/08/2030		2 500	2 192	0,06
4,750 % éch. 15/02/2028		2 300	2 186	0,06
Virgin Money UK PLC				
3,375 % éch. 24/04/2026	£	200	$ 222	0,01
4,000 % éch. 25/09/2026		600	671	0,02
Volkswagen Financial Services NV				
0,875 % éch. 20/02/2025		3 200	3 480	0,10
1,125 % éch. 18/09/2023		3 300	3 873	0,11
2,750 % éch. 10/07/2023		2 400	2 860	0,08
Wells Fargo & Co.				
3,000 % éch. 22/04/2026	$	2 100	1 967	0,06
3,526 % éch. 24/03/2028		2 600	2 412	0,07
Workspace Group PLC				
2,250 % éch. 11/03/2028	£	2 700	2 422	0,07
WPC Eurobond BV				
1,350 % éch. 15/04/2028	€	1 700	1 512	0,04
			535 122	**15,36**
INDUSTRIE				
AA Bond Co. Ltd.				
3,250 % éch. 31/07/2050	£	2 300	2 071	0,06
Accor S.A.				
2,375 % éch. 29/11/2028	€	3 500	3 204	0,09
Aeroporti di Roma SpA				
1,750 % éch. 30/07/2031		3 800	3 029	0,09
5,441 % éch. 20/02/2023	£	300	360	0,01
Air Canada				
3,875 % éch. 15/08/2026	$	1 300	1 154	0,03
Air Canada Pass-Through Trust				
3,600 % éch. 15/09/2028		1 073	970	0,03
Alaska Airlines Pass-Through Trust				
4,800 % éch. 15/02/2029		928	884	0,03
Allegiant Travel Co.				
7,250 % éch. 15/08/2027		2 600	2 477	0,07
Altice France S.A.				
4,250 % éch. 15/10/2029	€	2 300	1 851	0,05
5,500 % éch. 15/10/2029	$	2 500	1 911	0,06
AMC Networks, Inc.				
4,750 % éch. 01/08/2025		1 700	1 295	0,04
American Airlines Pass-Through Trust				
3,000 % éch. 15/04/2030		433	376	0,01
3,250 % éch. 15/04/2030		144	112	0,00
3,350 % éch. 15/04/2031		832	720	0,02
3,375 % éch. 01/11/2028		1 001	837	0,02
3,575 % éch. 15/07/2029		1 000	895	0,03
3,700 % éch. 01/04/2028		173	149	0,00
American Airlines, Inc.				
5,500 % éch. 20/04/2026		1 300	1 252	0,04
5,750 % éch. 20/04/2029		3 900	3 572	0,10
Atlantia SpA				
1,875 % éch. 12/02/2028	€	10 100	8 987	0,26
Bayer U.S. Finance LLC				
3,875 % éch. 15/12/2023	$	400	394	0,01
5,779 % éch. 15/12/2023		200	200	0,01
Becton Dickinson Euro Finance SARL				
1,336 % éch. 13/08/2041	€	3 100	2 061	0,06
Bellis Acquisition Co. PLC				
3,250 % éch. 16/02/2026	£	7 600	7 473	0,21
Boeing Co.				
1,950 % éch. 01/02/2024	$	700	675	0,02
2,750 % éch. 01/02/2026		5 100	4 732	0,14
British Airways Pass-Through Trust				
2,900 % éch. 15/09/2036		1 574	1 286	0,04
4,250 % éch. 15/05/2034		698	627	0,02
Broadcom, Inc.				
3,137 % éch. 15/11/2035		4	3	0,00
4,926 % éch. 15/05/2037		4	4	0,00
Caesars Entertainment, Inc.				
6,250 % éch. 01/07/2025		400	390	0,01
Carnival Holdings Bermuda Ltd.				
10,375 % éch. 01/05/2028		2 500	2 571	0,07
CCO Holdings LLC				
5,000 % éch. 01/02/2028		1 550	1 411	0,04
Charter Communications Operating LLC				
3,500 % éch. 01/06/2041		2 000	1 310	0,04
3,900 % éch. 01/06/2052		1 900	1 200	0,03
4,908 % éch. 23/07/2025		2 970	2 914	0,08
6,384 % éch. 23/10/2035		875	856	0,02
6,484 % éch. 23/10/2045		1 100	997	0,03
6,834 % éch. 23/10/2055		150	139	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Cigna Corp.				
3,750 % éch. 15/07/2023	$	794	$ 789	0,02
Cloud Software Group Holdings, Inc.				
6,500 % éch. 31/03/2029		3 800	3 207	0,09
Constellation Oil Services Holding S.A.				
13,500 % éch. 30/06/2025		341	339	0,01
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature)				
3,000 % éch. 31/12/2026 (c)		928	549	0,02
Coty, Inc.				
3,875 % éch. 15/04/2026	€	4 200	4 187	0,12
4,750 % éch. 15/01/2029	$	2 000	1 813	0,05
DAE Funding LLC				
1,625 % éch. 15/02/2024		2 500	2 374	0,07
DISH DBS Corp.				
5,250 % éch. 01/12/2026		1 000	844	0,02
5,750 % éch. 01/12/2028		2 000	1 600	0,05
Exela Intermediate LLC				
11,500 % éch. 15/07/2026		1 126	197	0,01
Expedia Group, Inc.				
2,950 % éch. 15/03/2031		540	436	0,01
6,250 % éch. 01/05/2025		2 069	2 088	0,06
Ford Motor Co.				
3,250 % éch. 12/02/2032		1 300	977	0,03
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide				
2,125 % éch. 09/07/2027	€	1 900	1 820	0,05
Global Payments, Inc.				
5,300 % éch. 15/08/2029	$	1 800	1 744	0,05
GN Store Nord A/S				
0,875 % éch. 25/11/2024	€	3 400	3 268	0,09
Grifols Escrow Issuer S.A.				
3,875 % éch. 15/10/2028		3 100	2 799	0,08
GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC				
3,375 % éch. 24/03/2029	$	1 850	1 667	0,05
GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC				
3,125 % éch. 24/03/2025		3 000	2 856	0,08
HCA, Inc.				
5,375 % éch. 01/09/2026		900	891	0,03
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
3,750 % éch. 01/05/2029		300	260	0,01
4,000 % éch. 01/05/2031		3 200	2 684	0,08
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC				
5,000 % éch. 01/06/2029		4 000	3 445	0,10
Holding d'Infrastructures des Métiers de l'Environnement				
0,125 % éch. 16/09/2025	€	1 600	1 509	0,04
0,625 % éch. 16/09/2028		2 200	1 843	0,05
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % en numéraire ou 4,500 % de rémunération en nature)				
3,750 % éch. 15/09/2026 (c)		3 200	2 979	0,09
Imperial Brands Finance Netherlands BV				
1,750 % éch. 18/03/2033		1 700	1 282	0,04
Imperial Brands Finance PLC				
2,125 % éch. 12/02/2027		2 500	2 407	0,07
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
6,500 % éch. 15/03/2030	$	1 406	1 260	0,04
JetBlue Pass-Through Trust				
2,750 % éch. 15/11/2033		173	143	0,00
Kraft Heinz Foods Co.				
5,000 % éch. 15/07/2035		73	70	0,00
Las Vegas Sands Corp.				
3,900 % éch. 08/08/2029		200	169	0,01
Lendlease Europe Finance PLC				
3,500 % éch. 02/12/2033	£	2 200	1 701	0,05
Melco Resorts Finance Ltd.				
5,375 % éch. 04/12/2029	$	200	161	0,00
Mileage Plus Holdings LLC				
6,500 % éch. 20/06/2027		5 940	5 919	0,17
MPH Acquisition Holdings LLC				
5,500 % éch. 01/09/2028		3 300	2 581	0,07
Nidec Corp.				
0,046 % éch. 30/03/2026	€	1 100	1 049	0,03
Nissan Motor Co. Ltd.				
3,522 % éch. 17/09/2025	$	7 500	6 974	0,20
4,345 % éch. 17/09/2027		1 700	1 544	0,04
4,810 % éch. 17/09/2030		500	425	0,01
Penske Truck Leasing Co. LP				
3,950 % éch. 10/03/2025	$	2 000	$ 1 928	0,06
Petroleos Mexicanos				
6,700 % éch. 16/02/2032		4 981	3 921	0,11
Prosus NV				
3,680 % éch. 21/01/2030		600	500	0,01
Sabine Pass Liquefaction LLC				
4,200 % éch. 15/03/2028		4 000	3 767	0,11
5,000 % éch. 15/03/2027		800	786	0,02
Sands China Ltd.				
3,350 % éch. 08/03/2029		900	737	0,02
3,750 % éch. 08/08/2031		1 100	867	0,03
5,900 % éch. 08/08/2028		7 800	7 314	0,21
Scripps Escrow, Inc.				
5,375 % éch. 15/01/2031		1 600	1 285	0,04
Sixt SE				
1,750 % éch. 09/12/2024	€	500	515	0,01
Southern Co.				
3,700 % éch. 30/04/2030	$	400	362	0,01
Studio City Finance Ltd.				
5,000 % éch. 15/01/2029		600	444	0,01
Syngenta Finance NV				
3,375 % éch. 16/04/2026	€	1 000	1 009	0,03
T-Mobile USA, Inc.				
2,250 % éch. 15/11/2031	$	2 300	1 815	0,05
3,300 % éch. 15/02/2051		2 700	1 814	0,05
3,875 % éch. 15/04/2030		4 200	3 814	0,11
TD SYNNEX Corp.				
2,375 % éch. 09/08/2028		5 800	4 690	0,13
TDF Infrastructure SASU				
1,750 % éch. 01/12/2029	€	6 400	5 199	0,15
Tesco Corporate Treasury Services PLC				
0,875 % éch. 29/05/2026		2 200	2 129	0,06
Toyota Tsusho Corp.				
3,625 % éch. 13/09/2023	$	3 400	3 362	0,10
United Airlines Pass-Through Trust				
5,875 % éch. 15/04/2029		3 399	3 356	0,10
United Airlines, Inc.				
4,625 % éch. 15/04/2029		200	175	0,01
Venture Global Calcasieu Pass LLC				
3,875 % éch. 01/11/2033		6 400	5 240	0,15
Virgin Media Secured Finance PLC				
4,250 % éch. 15/01/2030	£	4 000	3 754	0,11
Vmed O2 UK Financing PLC				
4,500 % éch. 15/07/2031		2 800	2 587	0,07
Wabtec Transportation Netherlands BV				
1,250 % éch. 03/12/2027	€	4 600	4 174	0,12
Warnermedia Holdings, Inc.				
3,528 % éch. 15/03/2024	$	3 100	3 006	0,09
WMG Acquisition Corp.				
2,250 % éch. 15/08/2031	€	2 300	1 930	0,06
Wynn Macau Ltd.				
5,500 % éch. 15/01/2026	$	400	368	0,01
5,500 % éch. 01/10/2027		200	175	0,01
			209 222	**6,01**

SERVICES AUX COLLECTIVITÉS

AES Corp.				
2,450 % éch. 15/01/2031		2 200	1 755	0,05
CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.				
1,500 % éch. 17/10/2031	€	2 500	2 052	0,06
2,625 % éch. 17/10/2034	£	2 500	2 039	0,06
Entergy Corp.				
2,400 % éch. 15/06/2031	$	300	239	0,01
Georgia Power Co.				
4,700 % éch. 15/05/2032		1 200	1 161	0,03
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
4,625 % éch. 15/07/2027		350	345	0,01
ONEOK, Inc.				
4,350 % éch. 15/03/2029		100	93	0,00
Pacific Gas & Electric Co.				
3,000 % éch. 15/06/2028		2 400	2 079	0,06
3,150 % éch. 01/01/2026		500	465	0,01
3,250 % éch. 01/06/2031		2 400	1 957	0,06
3,300 % éch. 01/12/2027 ^		3 000	2 653	0,07
3,500 % éch. 15/06/2025 ^		200	189	0,01
3,500 % éch. 01/08/2050	$	300	$ 187	0,01
4,300 % éch. 15/03/2045 ^		500	356	0,01
4,550 % éch. 01/07/2030		4 100	3 726	0,11
4,950 % éch. 08/06/2025		1 500	1 478	0,04
5,450 % éch. 15/06/2027		200	198	0,01
Rio Oil Finance Trust				
9,250 % éch. 06/07/2024		952	967	0,03
9,750 % éch. 06/01/2027		785	817	0,02
Southern California Gas Co.				
2,950 % éch. 15/04/2027		1 900	1 755	0,05
Southern Co. Gas Capital Corp.				
2,450 % éch. 01/10/2023		500	489	0,01
Sprint LLC				
7,125 % éch. 15/06/2024		800	817	0,02
			25 817	**0,74**
Total des Obligations et billets privés			770 161	22,11

OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES

Royal Caribbean Cruises Ltd.			
4,250 % éch. 15/06/2023	5 000	4 986	0,14
Southwest Airlines Co.			
1,250 % éch. 01/05/2025	7 500	9 036	0,26
		14 022	**0,40**

OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX

Obligations California State General Obligation Bonds, (BABs), (AGM/CR Insured), Series 2010			
6,875 % éch. 01/11/2026	2 345	2 521	0,07
Obligations Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2022			
0,000 % éch. 01/11/2043	40	17	0,00
Billets Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021			
1,337 % éch. 01/06/2023	3 400	3 351	0,10
1,711 % éch. 01/06/2024	1 900	1 809	0,05
Obligations Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010			
7,350 % éch. 01/07/2035	696	733	0,02
Obligations Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007			
0,000 % éch. 01/06/2047 (e)	23 300	1 735	0,05
Obligations Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020			
3,151 % éch. 01/06/2032	1 500	1 204	0,04
3,301 % éch. 01/06/2033	800	635	0,02
		12 005	**0,35**

AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN

Fannie Mae			
0,000 % éch. 25/09/2060 (a)	14 498	1 187	0,03
0,471 % éch. 25/07/2042 (a)	21 247	287	0,01
0,614 % éch. 25/06/2042 (a)	16 533	212	0,01
1,511 % éch. 25/12/2056 (a)	3 863	500	0,01
1,661 % éch. 25/07/2059 (a)	9 382	1 178	0,03
1,711 % éch. 25/07/2050 (a)	4 460	445	0,01
1,761 % éch. 25/07/2043 (a)	1 148	127	0,00
1,795 % éch. 01/12/2034	2	2	0,00
1,811 % éch. 25/05/2048 (a)	1 907	210	0,01
2,000 % éch. 25/11/2050 (a)	4 234	429	0,01
2,051 % éch. 25/11/2046 (a)	6 244	248	0,01
2,111 % éch. 25/03/2042 (a)	7 397	761	0,02
2,211 % éch. 25/11/2035 (a)	96	3	0,00
2,236 % éch. 25/06/2043 (a)	5 489	365	0,01
2,241 % éch. 25/10/2039 (a)	1 805	40	0,00
2,462 % éch. 01/02/2035	4	4	0,00
2,889 % éch. 01/11/2042	11	11	0,00
4,000 % éch. 25/06/2050 (a)	6 090	1 233	0,04
4,509 % éch. 25/03/2034	30	30	0,00
4,519 % éch. 25/11/2031	11	11	0,00
4,529 % éch. 25/02/2032	25	25	0,00
4,559 % éch. 25/11/2032	8	8	0,00
4,739 % éch. 25/03/2037	19	19	0,00
4,789 % éch. 18/10/2030 - 25/09/2032	6	5	0,00
8,475 % éch. 25/03/2036	286	312	0,01
Freddie Mac			
0,217 % éch. 15/08/2042	1 062	721	0,02
1,500 % éch. 25/12/2035 (a)	8 832	401	0,01

Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
1,612 % éch. 15/12/2037 (a)	$	336	$ 23	0,00
1,711 % éch. 25/06/2050 (a)		9 839	1 029	0,03
1,761 % éch. 25/06/2050 (a)		13 109	1 837	0,05
1,832 % éch. 15/07/2047 (a)		142	16	0,00
2,000 % éch. 25/12/2050 (a)		20 459	1 978	0,06
2,292 % éch. 15/04/2042 (a)		163	17	0,00
2,575 % éch. 01/09/2027		1	1	0,00
3,448 % éch. 25/07/2044		354	355	0,01
4,000 % éch. 15/01/2033 - 25/07/2050 (a)		18 395	3 698	0,11
4,000 % éch. 01/07/2047		114	109	0,00
4,669 % éch. 25/09/2031		91	91	0,00
5,500 % éch. 01/04/2027 - 01/01/2040		475	488	0,01
Ginnie Mae				
1,750 % éch. 20/11/2029		2	2	0,00
2,625 % éch. 20/09/2031		110	109	0,00
3,500 % éch. 15/07/2045		11 168	10 416	0,30
4,000 % éch. 20/10/2042 (a)		3 798	677	0,02
4,000 % éch. 15/02/2052		4 623	4 408	0,13
4,500 % éch. 20/10/2045 (a)		2 535	528	0,02
Ginnie Mae, TBA				
4,000 % éch. 01/01/2053		3 000	2 845	0,08
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)				
3,500 % éch. 01/04/2037 - 01/07/2048		12 713	11 809	0,34
4,000 % éch. 01/05/2047 - 01/03/2049		9 947	9 535	0,27
4,500 % éch. 01/04/2028		5	5	0,00
5,500 % éch. 01/07/2026 - 01/08/2040		506	515	0,02
6,000 % éch. 01/10/2025 - 01/05/2041		262	269	0,01
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				
2,500 % éch. 01/02/2053		30 200	25 606	0,74
3,000 % éch. 01/02/2053		50 300	44 195	1,27
3,500 % éch. 01/02/2053		119 800	108 922	3,13
4,000 % éch. 01/02/2053		12 600	11 821	0,34
4,500 % éch. 01/02/2053		42 800	41 203	1,18
			291 281	**8,36**
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Billets du Trésor américain				
0,250 % éch. 31/08/2025		12 200	10 972	0,31
1,250 % éch. 31/08/2024		84 500	80 008	2,30
			90 980	**2,61**
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,390 % éch. 25/10/2035 ^		133	127	0,00
3,611 % éch. 25/11/2035 ^		267	206	0,01
3,769 % éch. 25/02/2036 ^		1 334	944	0,03
3,845 % éch. 25/01/2036 ^		37	32	0,00
3,960 % éch. 25/08/2035		24	24	0,00
4,182 % éch. 25/03/2037 ^		8	7	0,00
4,536 % éch. 25/01/2036		1 070	942	0,03
Alba PLC				
3,714 % éch. 17/03/2039	£	1 032	1 170	0,03
American Home Mortgage Assets Trust				
2,968 % éch. 25/11/2046	$	60	19	0,00
4,809 % éch. 25/06/2037		3 129	2 858	0,08
6,750 % éch. 25/11/2046		790	673	0,02
American Home Mortgage Investment Trust				
6,959 % éch. 25/11/2045 ^		234	111	0,00
Banc of America Alternative Loan Trust				
2,251 % éch. 25/06/2037 ^(a)		669	60	0,00
4,749 % éch. 25/06/2037		616	459	0,01
6,000 % éch. 25/06/2046 ^		259	225	0,01
6,000 % éch. 25/07/2046 ^		540	451	0,01
Banc of America Funding Trust				
2,917 % éch. 20/10/2046 ^		72	56	0,00
3,426 % éch. 20/04/2035 ^		940	808	0,02
3,436 % éch. 20/12/2034 ^		12	9	0,00
3,473 % éch. 20/05/2036 ^		159	150	0,00
3,537 % éch. 20/06/2036 ^		12	11	0,00
3,714 % éch. 20/06/2037 ^		62	53	0,00
3,863 % éch. 20/11/2034		458	420	0,01
3,958 % éch. 20/02/2036		103	97	0,00
4,273 % éch. 20/01/2047 ^		382	349	0,01
4,449 % éch. 25/01/2037 ^	$	104	$ 89	0,00
4,673 % éch. 20/02/2047		669	657	0,02
4,733 % éch. 20/07/2036		4 122	3 958	0,11
4,733 % éch. 20/12/2046 ^		208	170	0,01
5,189 % éch. 25/05/2037 ^		632	547	0,02
Banc of America Mortgage Trust				
2,543 % éch. 25/02/2035		78	74	0,00
3,200 % éch. 25/05/2035 ^		237	208	0,01
3,313 % éch. 25/06/2035		49	41	0,00
3,348 % éch. 25/01/2035		30	29	0,00
5,750 % éch. 20/07/2032		0	0	0,00
BCAP LLC Trust				
3,400 % éch. 26/11/2036		1 422	1 356	0,04
4,611 % éch. 26/03/2037		1 190	1 613	0,05
4,729 % éch. 25/01/2037 ^		1 985	1 676	0,05
4,749 % éch. 25/03/2037		759	660	0,02
5,250 % éch. 26/02/2036		568	252	0,01
5,250 % éch. 26/06/2036		12 617	5 407	0,16
5,250 % éch. 26/04/2037		636	381	0,01
5,250 % éch. 26/06/2037		143	127	0,00
5,689 % éch. 25/09/2047		917	796	0,02
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
2,842 % éch. 25/04/2033		7	7	0,00
3,239 % éch. 25/04/2033		3	3	0,00
3,250 % éch. 25/02/2033		1	0	0,00
3,255 % éch. 25/05/2047 ^		606	537	0,02
3,575 % éch. 25/09/2034		316	292	0,01
3,844 % éch. 25/07/2034		46	41	0,00
3,874 % éch. 25/01/2035		286	264	0,01
3,992 % éch. 25/08/2035 ^		61	56	0,00
4,010 % éch. 25/01/2034		38	37	0,00
4,045 % éch. 25/08/2033		103	96	0,00
4,111 % éch. 25/11/2034		48	45	0,00
4,251 % éch. 25/01/2035		23	21	0,00
4,363 % éch. 25/01/2035		37	33	0,00
4,669 % éch. 25/11/2034		39	34	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,115 % éch. 25/05/2035		320	298	0,01
3,250 % éch. 25/02/2034		8	7	0,00
3,257 % éch. 25/04/2035		60	52	0,00
3,341 % éch. 25/05/2036 ^		593	343	0,01
3,546 % éch. 25/09/2035 ^		3 845	1 668	0,05
3,602 % éch. 25/11/2036		3 247	1 850	0,05
3,625 % éch. 25/03/2036 ^		325	263	0,01
3,668 % éch. 25/11/2036 ^		1 207	560	0,02
3,822 % éch. 25/09/2034		97	89	0,00
4,265 % éch. 25/01/2034		45	41	0,00
4,709 % éch. 25/02/2034		143	127	0,00
4,729 % éch. 25/08/2036 ^		187	153	0,00
4,789 % éch. 25/02/2034		710	629	0,02
4,829 % éch. 25/04/2036 ^		447	619	0,02
4,869 % éch. 25/02/2036		406	396	0,01
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				
4,569 % éch. 25/06/2037		627	550	0,02
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				
5,219 % éch. 26/12/2046 ^		508	366	0,01
Canada Square Funding PLC				
3,735 % éch. 17/01/2059	£	2 380	2 753	0,08
Canterbury Finance				
3,985 % éch. 16/05/2058		1 282	1 519	0,04
Charter Mortgage Funding PLC				
3,935 % éch. 16/01/2057		1 659	1 983	0,06
Chase Mortgage Finance Trust				
3,162 % éch. 25/03/2037 ^	$	344	310	0,01
3,393 % éch. 25/03/2037 ^		28	26	0,00
3,492 % éch. 25/02/2037		18	17	0,00
ChaseFlex Trust				
4,689 % éch. 25/07/2037		11	11	0,00
ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
4,112 % éch. 25/08/2037 ^		818	687	0,02
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				
4,569 % éch. 25/05/2036		31	26	0,00
Citicorp Mortgage Securities Trust				
6,000 % éch. 25/09/2037		34	33	0,00
Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc.				
4,889 % éch. 25/05/2032		28	25	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust				
2,358 % éch. 25/03/2034		70	66	0,00
2,960 % éch. 25/10/2046 ^		336	296	0,01
3,595 % éch. 25/07/2037 ^	$	8	$ 7	0,00
3,734 % éch. 25/09/2037 ^		91	81	0,00
3,885 % éch. 25/08/2035		46	45	0,00
3,950 % éch. 25/05/2035		66	62	0,00
6,470 % éch. 25/11/2035		70	66	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
2,409 % éch. 25/02/2034		12	12	0,00
3,440 % éch. 25/09/2035		1	1	0,00
CitiMortgage Alternative Loan Trust				
4,989 % éch. 25/01/2037		1 170	973	0,03
4,989 % éch. 25/06/2037		1 711	1 401	0,04
5,039 % éch. 25/09/2036		1 543	1 305	0,04
6,000 % éch. 25/10/2037 ^		717	625	0,02
Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust				
6,000 % éch. 25/05/2036 ^		100	61	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust				
0,611 % éch. 25/12/2035 (a)		1 075	75	0,00
3,048 % éch. 25/12/2035		2 336	1 899	0,06
4,533 % éch. 20/02/2047 ^		334	253	0,01
4,543 % éch. 20/03/2047		5 267	4 182	0,12
4,548 % éch. 20/12/2046 ^		11 669	9 396	0,27
4,589 % éch. 25/04/2047		248	227	0,01
4,633 % éch. 20/09/2046		585	378	0,01
4,669 % éch. 25/06/2037		754	658	0,02
4,669 % éch. 25/04/2047		1 265	1 101	0,03
4,709 % éch. 25/09/2047		606	524	0,02
4,729 % éch. 25/05/2047		603	509	0,02
4,749 % éch. 25/05/2047		830	699	0,02
4,759 % éch. 25/02/2037 ^		1 971	615	0,02
4,769 % éch. 25/07/2046 ^		401	383	0,01
4,769 % éch. 25/09/2046 ^		18	17	0,00
4,773 % éch. 20/03/2046		53	42	0,00
4,773 % éch. 20/05/2046 ^		313	258	0,01
4,789 % éch. 25/05/2036 ^		439	348	0,01
4,839 % éch. 25/09/2035 ^		251	155	0,01
4,869 % éch. 25/01/2037		2 257	1 826	0,05
4,889 % éch. 25/12/2035 ^		106	51	0,00
4,889 % éch. 25/12/2035		1 077	525	0,02
4,949 % éch. 25/02/2037		773	628	0,02
4,969 % éch. 25/02/2036 ^		1 751	1 536	0,04
4,993 % éch. 20/11/2035		21	17	0,00
5,000 % éch. 25/03/2035		6	5	0,00
5,099 % éch. 25/07/2036 ^		562	223	0,01
5,289 % éch. 25/12/2036 ^		645	217	0,01
5,500 % éch. 25/04/2035		127	90	0,00
5,500 % éch. 25/11/2035 ^		175	110	0,00
5,500 % éch. 25/12/2035 ^		3 279	2 164	0,06
5,500 % éch. 25/01/2036		22	14	0,00
5,689 % éch. 25/10/2035 ^		1 370	974	0,03
5,750 % éch. 25/02/2035		153	107	0,00
5,750 % éch. 25/07/2035 ^		679	435	0,01
5,750 % éch. 25/05/2036		434	195	0,01
5,750 % éch. 25/03/2037 ^		402	231	0,01
6,000 % éch. 25/04/2036 ^		218	115	0,00
6,000 % éch. 25/04/2036		602	298	0,01
6,000 % éch. 25/08/2036 ^		126	77	0,00
6,000 % éch. 25/12/2036 ^		1 306	575	0,02
6,000 % éch. 25/02/2037 ^		238	109	0,00
6,000 % éch. 25/03/2037 ^		287	115	0,00
6,000 % éch. 25/04/2037 ^		563	284	0,01
6,000 % éch. 25/05/2037 ^		97	51	0,00
6,000 % éch. 25/08/2037 ^		647	337	0,01
6,500 % éch. 25/08/2032		44	43	0,00
6,500 % éch. 25/09/2037 ^		561	238	0,01
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
2,241 % éch. 20/07/2034		79	74	0,00
2,900 % éch. 20/04/2036 ^		10	9	0,00
2,980 % éch. 25/04/2035		32	24	0,00
3,229 % éch. 20/05/2036 ^		667	607	0,02
3,366 % éch. 20/05/2036		373	331	0,01
3,677 % éch. 20/02/2036		537	429	0,01
4,849 % éch. 25/05/2035		38	31	0,00
4,969 % éch. 25/04/2035		41	36	0,00
5,029 % éch. 25/03/2035		271	218	0,01
5,049 % éch. 25/02/2035		37	31	0,00
5,129 % éch. 25/02/2035		811	674	0,02
5,250 % éch. 25/12/2027 ^		23	15	0,00
5,500 % éch. 25/11/2035 ^		4	2	0,00
5,750 % éch. 25/02/2037 ^		374	184	0,01
5,750 % éch. 25/05/2037 ^		24	13	0,00
5,750 % éch. 25/08/2037		2 122	1 174	0,03
5,910 % éch. 20/02/2036 ^		26	22	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
6,000 % éch. 25/09/2037 ^	$	85	$ 47	0,00
6,500 % éch. 25/12/2037		1 430	663	0,02
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				
6,500 % éch. 25/11/2034 ^		16	14	0,00
6,500 % éch. 25/03/2035 ^		476	454	0,01
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
3,792 % éch. 25/03/2032		28	26	0,00
6,000 % éch. 25/01/2036 ^		481	297	0,01
6,500 % éch. 25/04/2033		4	4	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-through Certificates				
3,984 % éch. 25/10/2033		9	9	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				
3,276 % éch. 30/11/2037		3 934	3 601	0,10
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				
4,989 % éch. 25/02/2037		3 918	1 919	0,06
6,250 % éch. 25/08/2036 ^		43	18	0,00
7,000 % éch. 25/08/2037 ^		384	212	0,01
Credit Suisse Mortgage Capital Trust				
3,861 % éch. 25/06/2050		1 916	1 616	0,05
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				
4,529 % éch. 25/07/2047		385	339	0,01
4,689 % éch. 25/03/2037 ^		250	233	0,01
4,689 % éch. 25/09/2047 ^		699	591	0,02
4,719 % éch. 25/08/2037 ^		1 473	1 247	0,04
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				
3,728 % éch. 19/07/2044		197	177	0,01
4,529 % éch. 19/10/2036		623	500	0,01
Dutch Property Finance BV				
2,228 % éch. 28/07/2054	€	1 777	1 876	0,05
EMF-NL Prime BV				
2,178 % éch. 17/04/2041		1 411	1 444	0,04
European Loan Conduit DAC				
2,803 % éch. 17/02/2030		4 205	4 293	0,12
Eurosail BV				
2,878 % éch. 17/10/2040		413	439	0,01
Eurosail PLC				
2,255 % éch. 13/03/2045		3 632	3 424	0,10
3,761 % éch. 13/03/2045	£	7 250	7 701	0,22
3,984 % éch. 10/06/2044		6 316	7 171	0,21
4,461 % éch. 13/06/2045		10 812	12 324	0,35
Finsbury Square PLC				
4,209 % éch. 16/03/2070		2 647	3 176	0,09
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				
3,858 % éch. 25/09/2034	$	51	46	0,00
4,088 % éch. 25/01/2036 ^		343	192	0,01
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				
3,875 % éch. 25/08/2035		25	17	0,00
Friary PLC				
3,993 % éch. 21/11/2067	£	658	794	0,02
GMAC Mortgage Corp. Loan Trust				
2,985 % éch. 19/04/2036 ^	$	46	35	0,00
Great Hall Mortgages PLC				
4,868 % éch. 18/06/2039		20	20	0,00
Greenpoint Mortgage Funding Trust				
4,929 % éch. 25/11/2045		229	207	0,01
5,009 % éch. 25/10/2045		12	11	0,00
GSR Mortgage Loan Trust				
2,261 % éch. 25/01/2037 (a)		3 093	333	0,01
3,719 % éch. 25/11/2035		60	53	0,00
3,767 % éch. 25/09/2035		152	143	0,00
3,960 % éch. 25/11/2035 ^		90	53	0,00
5,750 % éch. 25/03/2036 ^		10	9	0,00
5,750 % éch. 25/01/2037 ^		19	12	0,00
6,000 % éch. 25/03/2032		0	0	0,00
6,000 % éch. 25/11/2035 ^		831	362	0,01
6,000 % éch. 25/03/2037 ^		49	28	0,00
6,000 % éch. 25/05/2037 ^		130	94	0,00
6,500 % éch. 25/09/2036 ^		80	40	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust				
3,302 % éch. 19/10/2033		29	25	0,00
3,435 % éch. 19/06/2045 ^		1 099	549	0,02
4,549 % éch. 25/05/2038		508	400	0,01
4,779 % éch. 19/05/2035		143	128	0,00
4,839 % éch. 19/01/2036		682	416	0,01
4,899 % éch. 19/02/2036		226	120	0,00
5,159 % éch. 19/11/2034 ^		81	69	0,00
Harmony French Home Loans				
2,558 % éch. 27/05/2062	€	6 709	$ 7 177	0,21
HomeBanc Mortgage Trust				
2,839 % éch. 25/04/2037 ^	$	2 047	1 836	0,05
Impac CMB Trust				
5,029 % éch. 25/09/2034		3	3	0,00
5,029 % éch. 25/03/2035		362	329	0,01
5,049 % éch. 25/03/2035		392	366	0,01
5,169 % éch. 25/10/2034		295	282	0,01
5,309 % éch. 25/11/2034		17	17	0,00
IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,686 % éch. 25/01/2032		14	12	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust				
2,950 % éch. 25/06/2037		873	483	0,01
3,064 % éch. 25/07/2037		2 069	1 340	0,04
3,160 % éch. 25/07/2037		461	197	0,01
3,215 % éch. 25/06/2036		262	237	0,01
3,324 % éch. 25/06/2037 ^		64	44	0,00
3,833 % éch. 25/10/2034		217	205	0,01
4,749 % éch. 25/07/2047		611	421	0,01
4,809 % éch. 25/07/2036		797	701	0,02
4,989 % éch. 25/07/2035		218	177	0,01
5,029 % éch. 25/02/2035		58	50	0,00
5,189 % éch. 25/11/2034		97	84	0,00
5,209 % éch. 25/11/2034 ^		71	58	0,00
6,500 % éch. 25/07/2037 ^		3 024	982	0,03
JPMorgan Alternative Loan Trust				
3,203 % éch. 25/03/2036 ^		211	174	0,01
4,749 % éch. 25/06/2037		9 554	5 280	0,15
5,843 % éch. 26/05/2037		1 065	828	0,02
JPMorgan Mortgage Trust				
2,783 % éch. 25/04/2036 ^		8	7	0,00
3,196 % éch. 27/07/2037		133	121	0,00
3,285 % éch. 25/05/2034		6	6	0,00
3,615 % éch. 25/10/2035 ^		166	134	0,00
3,763 % éch. 25/11/2035 ^		21	17	0,00
3,834 % éch. 25/12/2034		19	18	0,00
5,750 % éch. 25/01/2036 ^		52	26	0,00
6,000 % éch. 25/08/2037 ^		264	146	0,00
6,250 % éch. 25/07/2036 ^		143	69	0,00
6,500 % éch. 25/08/2036 ^		251	105	0,00
Lehman Mortgage Trust				
5,909 % éch. 25/04/2036 ^		1 111	735	0,02
Lehman XS Trust				
4,839 % éch. 25/08/2046		148	139	0,00
4,944 % éch. 25/08/2047 ^		518	445	0,01
Luminent Mortgage Trust				
4,749 % éch. 25/12/2036 ^		20	18	0,00
Mansard Mortgages PLC				
3,305 % éch. 15/04/2049	£	3 417	3 697	0,11
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				
2,871 % éch. 25/07/2035 ^	$	187	161	0,01
3,215 % éch. 25/05/2034		57	52	0,00
3,874 % éch. 21/11/2034		121	109	0,00
MASTR Seasoned Securitization Trust				
4,337 % éch. 25/10/2032		79	77	0,00
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				
5,018 % éch. 15/11/2031		26	25	0,00
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				
4,758 % éch. 15/12/2030		224	209	0,01
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
2,736 % éch. 25/03/2036 ^		504	277	0,01
3,011 % éch. 25/05/2033		70	67	0,00
3,046 % éch. 25/02/2035		11	10	0,00
3,153 % éch. 25/07/2035 ^		35	30	0,00
4,385 % éch. 25/11/2035		53	49	0,00
4,863 % éch. 25/10/2028		14	13	0,00
6,709 % éch. 25/12/2032		5	5	0,00
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
2,980 % éch. 25/11/2037		1 598	1 047	0,03
3,188 % éch. 25/12/2037		1 347	898	0,03
4,649 % éch. 25/04/2035		55	51	0,00
5,962 % éch. 25/06/2036 ^		748	229	0,01
6,354 % éch. 25/08/2036 ^		790	161	0,01
Morgan Stanley Re-REMIC Trust				
5,250 % éch. 26/05/2037		878	498	0,01
MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
4,849 % éch. 25/06/2047	$	1 508	$ 1 217	0,04
Newgate Funding PLC				
1,811 % éch. 01/12/2050	€	4 244	4 123	0,12
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				
3,189 % éch. 25/10/2035	$	136	83	0,00
4,042 % éch. 25/06/2036		1 343	1 006	0,03
5,459 % éch. 25/02/2035		319	312	0,01
NovaStar Mortgage Funding Trust				
0,412 % éch. 25/09/2046		1 912	669	0,02
OBX Trust				
5,039 % éch. 25/06/2057		196	185	0,01
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,675 % éch. 25/12/2035		0	0	0,00
Polaris PLC				
4,682 % éch. 27/05/2057	£	1 374	1 647	0,05
Precise Mortgage Funding PLC				
4,265 % éch. 16/10/2056		526	624	0,02
Prime Mortgage Trust				
8,000 % éch. 25/07/2034	$	352	273	0,01
RBSGC Structured Trust				
5,500 % éch. 25/11/2035 ^		760	639	0,02
RBSSP Resecuritization Trust				
4,256 % éch. 27/06/2036		4 946	3 796	0,11
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
2,644 % éch. 25/10/2037		178	155	0,01
3,548 % éch. 25/08/2035		55	45	0,00
4,506 % éch. 25/12/2035 ^		169	135	0,00
4,539 % éch. 25/02/2047		2 640	971	0,03
4,642 % éch. 25/01/2036 ^		208	163	0,01
4,689 % éch. 25/08/2035		205	155	0,01
4,769 % éch. 25/09/2036 ^		678	619	0,02
4,769 % éch. 25/12/2036		385	327	0,01
4,769 % éch. 25/05/2047		378	329	0,01
4,789 % éch. 25/11/2036 ^		112	82	0,00
4,889 % éch. 25/08/2037		99	88	0,00
4,949 % éch. 25/12/2045		69	55	0,00
6,000 % éch. 25/08/2036 ^		314	263	0,01
6,500 % éch. 25/09/2037 ^		116	91	0,00
Residential Asset Securitization Trust				
5,500 % éch. 25/06/2033		43	41	0,00
5,500 % éch. 25/09/2035 ^		17	9	0,00
5,500 % éch. 25/12/2035 ^		81	41	0,00
5,750 % éch. 25/02/2036 ^		125	49	0,00
6,000 % éch. 25/07/2037 ^		387	156	0,00
6,250 % éch. 25/08/2037		2 340	669	0,02
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				
3,726 % éch. 25/04/2037 ^		31	24	0,00
3,910 % éch. 25/09/2035 ^		330	206	0,01
4,545 % éch. 27/07/2037 ^		257	202	0,01
6,500 % éch. 25/03/2032		24	23	0,00
RESIMAC Bastille Trust				
5,022 % éch. 05/12/2059		55	55	0,00
5,102 % éch. 05/09/2057		1 687	1 686	0,05
Resloc UK PLC				
2,226 % éch. 15/12/2043	€	1 022	991	0,03
2,296 % éch. 15/12/2043		4 519	4 321	0,12
3,742 % éch. 15/12/2043	£	6 167	6 742	0,19
RMAC PLC				
4,206 % éch. 12/06/2046		1 306	1 563	0,05
Rochester Financing PLC				
4,126 % éch. 18/12/2044		1 796	2 083	0,06
Sequoia Mortgage Trust				
2,976 % éch. 20/01/2047 ^	$	146	98	0,00
4,168 % éch. 20/07/2033		24	20	0,00
4,272 % éch. 20/04/2035		52	51	0,00
Shamrock Residential DAC				
2,744 % éch. 24/01/2061	€	3 148	3 282	0,09
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				
3,656 % éch. 20/01/2054	£	3 452	4 052	0,12
Stratton Mortgage Funding PLC				
4,287 % éch. 12/03/2052		1 703	2 040	0,06
4,426 % éch. 20/07/2060		10 705	12 706	0,37
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,330 % éch. 25/04/2036 ^	$	124	76	0,00
3,780 % éch. 25/02/2034		142	133	0,00
3,838 % éch. 25/09/2035		88	78	0,00

Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
3,854 % éch. 25/04/2035	$	139	$ 129	0,00
3,944 % éch. 25/09/2034		266	250	0,01
3,957 % éch. 25/04/2034		1	1	0,00
4,113 % éch. 25/10/2035 ^		176	154	0,00
4,138 % éch. 25/04/2035		284	259	0,01
4,297 % éch. 25/07/2034		129	122	0,00
4,527 % éch. 25/12/2034		17	16	0,00
4,689 % éch. 25/09/2034		4	3	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
4,509 % éch. 25/08/2036		670	564	0,02
4,729 % éch. 25/03/2037 ^		67	19	0,00
4,749 % éch. 25/07/2046		404	331	0,01
4,769 % éch. 25/06/2036		62	59	0,00
4,789 % éch. 25/10/2036		1 321	1 115	0,03
4,809 % éch. 25/04/2036		337	289	0,01
4,809 % éch. 25/08/2036 ^		64	50	0,00
4,839 % éch. 19/07/2035		140	128	0,00
5,009 % éch. 25/12/2035 ^		171	136	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				
4,734 % éch. 25/12/2033		66	63	0,00
5,041 % éch. 25/06/2033		1	1	0,00
Thornburg Mortgage Securities Trust				
3,653 % éch. 25/07/2036		152	126	0,00
5,069 % éch. 25/04/2043		29	29	0,00
5,639 % éch. 25/06/2037 ^		383	331	0,01
6,666 % éch. 25/06/2037		2 428	2 176	0,06
Towd Point Mortgage Funding PLC				
4,071 % éch. 20/10/2051	£	13 887	16 606	0,48
Tower Bridge Funding PLC				
4,151 % éch. 20/12/2063		2 305	2 704	0,08
4,801 % éch. 20/09/2063		3 446	4 142	0,12
Twin Bridges PLC				
4,237 % éch. 12/03/2055		4 146	4 879	0,14
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
2,499 % éch. 25/12/2046	$	121	106	0,00
2,585 % éch. 25/03/2034		286	279	0,01
2,748 % éch. 25/02/2047 ^		629	524	0,02
2,778 % éch. 25/01/2047		171	155	0,00
2,788 % éch. 25/01/2047 ^		59	51	0,00
2,798 % éch. 25/06/2047 ^		5	3	0,00
2,808 % éch. 25/04/2047		1 084	939	0,03
3,028 % éch. 25/06/2046		281	259	0,01
3,030 % éch. 25/12/2046		187	175	0,01
3,048 % éch. 25/02/2046		352	310	0,01
3,048 % éch. 25/08/2046		380	348	0,01
3,096 % éch. 25/07/2046		252	205	0,01
3,096 % éch. 25/08/2046		3 015	2 302	0,07
3,122 % éch. 25/03/2036		10	9	0,00
3,211 % éch. 25/02/2037 ^		158	142	0,00
3,240 % éch. 25/06/2037 ^		76	66	0,00
3,266 % éch. 25/02/2037 ^		1 225	1 085	0,03
3,347 % éch. 25/05/2037 ^		31	24	0,00
3,448 % éch. 25/06/2042		11	10	0,00
3,448 % éch. 25/08/2042		48	45	0,00
3,548 % éch. 25/11/2046		2 048	1 768	0,05
3,738 % éch. 25/09/2036 ^		341	308	0,01
3,897 % éch. 25/08/2034		78	73	0,00
4,141 % éch. 25/10/2034		2	2	0,00
4,180 % éch. 25/09/2033		22	20	0,00
4,909 % éch. 25/11/2045		821	737	0,02
4,969 % éch. 25/07/2045		135	124	0,00
4,969 % éch. 25/10/2045		223	206	0,01
5,229 % éch. 25/07/2045		212	195	0,01
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
2,768 % éch. 25/12/2046		3 176	2 530	0,07
4,709 % éch. 25/02/2037 ^		215	176	0,01
4,989 % éch. 25/07/2036 ^		1 394	770	0,02
5,089 % éch. 25/01/2036 ^		347	279	0,01
5,500 % éch. 25/07/2035 ^		419	372	0,01
5,750 % éch. 25/11/2035 ^		326	300	0,01
6,000 % éch. 25/10/2035 ^		146	100	0,00
6,000 % éch. 25/03/2036 ^		283	261	0,01
Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,217 % éch. 25/02/2033		0	0	0,00
Wells Fargo Alternative Loan Trust				
4,739 % éch. 25/06/2037 ^		275	195	0,01
			285 842	**8,21**

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Accredited Mortgage Loan Trust				
5,334 % éch. 25/09/2035	$	6 171	$ 5 284	0,15
Accunia European CLO DAC				
2,308 % éch. 15/10/2030	€	2 757	2 894	0,08
2,328 % éch. 15/07/2030		3 745	3 918	0,11
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
4,509 % éch. 25/08/2036 ^	$	1 547	413	0,01
5,214 % éch. 25/12/2045 ^		1 028	793	0,02
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,094 % éch. 25/11/2035		3 845	3 769	0,11
5,259 % éch. 25/01/2036		600	564	0,02
5,409 % éch. 25/09/2034		1 608	1 569	0,05
AMMC CLO 21 Ltd.				
5,710 % éch. 02/11/2030		2 400	2 369	0,07
Amortizing Residential Collateral Trust				
5,089 % éch. 25/10/2031		23	22	0,00
AMRESCO Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
5,329 % éch. 25/06/2029		6	6	0,00
Aqueduct European CLO DAC				
2,096 % éch. 20/07/2030	€	2 692	2 817	0,08
Ares European CLO DAC				
2,306 % éch. 20/04/2032		2 900	3 006	0,09
2,582 % éch. 21/10/2033		8 500	8 888	0,26
Argent Mortgage Loan Trust				
4,869 % éch. 25/05/2035	$	2 097	1 878	0,05
Argent Securities Trust				
4,539 % éch. 25/09/2036		2 048	684	0,02
4,609 % éch. 25/05/2036		550	139	0,00
4,689 % éch. 25/06/2036		1 699	479	0,01
4,689 % éch. 25/07/2036		6 032	5 218	0,15
4,709 % éch. 25/05/2036		3 683	932	0,03
Armada Euro CLO DAC				
2,098 % éch. 15/07/2031	€	1 550	1 607	0,05
Asset-Backed Funding Certificates Trust				
4,499 % éch. 25/01/2037	$	1 046	620	0,02
4,549 % éch. 25/01/2037		427	254	0,01
5,089 % éch. 25/06/2034		743	698	0,02
5,439 % éch. 25/03/2034 ^		361	341	0,01
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
5,484 % éch. 25/02/2035		864	850	0,02
Aurium CLO DAC				
2,108 % éch. 16/01/2031	€	5 698	5 947	0,17
3,152 % éch. 23/03/2032		5 000	5 222	0,15
Avoca CLO DAC				
2,068 % éch. 15/07/2030		5 111	5 341	0,15
2,129 % éch. 12/01/2031		2 200	2 293	0,07
2,268 % éch. 15/04/2033		3 500	3 614	0,10
Babson CLO Ltd.				
5,233 % éch. 20/01/2031	$	5 700	5 611	0,16
Barings CLO Ltd.				
5,029 % éch. 15/04/2031		5 000	4 904	0,14
Barings Euro CLO DAC				
2,778 % éch. 25/11/2029	€	3 767	3 961	0,11
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
3,601 % éch. 25/06/2043	$	52	46	0,00
3,644 % éch. 25/07/2036		59	58	0,00
4,421 % éch. 25/11/2035 ^		829	745	0,02
4,539 % éch. 25/11/2036		1 254	1 201	0,03
4,619 % éch. 25/02/2037		3 784	3 461	0,10
5,019 % éch. 25/02/2036		1 318	1 314	0,04
5,032 % éch. 25/08/2034		197	195	0,01
5,244 % éch. 25/07/2034		1 585	1 516	0,04
5,389 % éch. 25/10/2037		44	44	0,00
5,439 % éch. 25/08/2037		96	86	0,00
5,500 % éch. 25/08/2036		17	17	0,00
Belle Haven ABS CDO Ltd.				
0,000 % éch. 03/11/2044		11 399	3 549	0,10
Black Diamond CLO DAC				
2,316 % éch. 20/01/2032	€	1 254	1 308	0,04
2,778 % éch. 15/05/2032		5 500	5 691	0,16
2,834 % éch. 03/10/2029		29	30	0,00
4,793 % éch. 03/10/2029	$	23	23	0,00
Blackrock European CLO DAC				
1,998 % éch. 15/10/2031	€	3 100	3 208	0,09

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
BlueMountain CLO Ltd.				
5,159 % éch. 15/07/2031	$	3 900	$ 3 836	0,11
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				
1,050 % éch. 15/01/2031	€	500	480	0,01
2,098 % éch. 15/01/2031		9 495	9 859	0,28
2,208 % éch. 15/04/2034		2 200	2 239	0,06
BNPP AM Euro CLO DAC				
2,028 % éch. 15/10/2031		1 480	1 548	0,04
2,322 % éch. 22/07/2032		5 800	5 998	0,17
Bosphorus CLO DAC				
2,866 % éch. 15/12/2030		1 448	1 507	0,04
3,000 % éch. 12/12/2032		3 400	3 523	0,10
Cairn CLO BV				
2,158 % éch. 15/10/2031		5 300	5 537	0,16
Cairn CLO DAC				
2,178 % éch. 30/04/2031		2 171	2 260	0,07
2,275 % éch. 31/01/2030		3 769	3 944	0,11
2,688 % éch. 20/10/2028		217	227	0,01
Carlyle Euro CLO DAC				
2,078 % éch. 15/01/2031		6 497	6 766	0,19
2,428 % éch. 15/08/2030		1 594	1 661	0,05
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				
2,338 % éch. 16/01/2033		5 600	5 755	0,17
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
2,548 % éch. 15/11/2031		11 100	11 480	0,33
Carrington Mortgage Loan Trust				
4,549 % éch. 25/10/2036	$	3 159	3 031	0,09
4,639 % éch. 25/10/2036		976	796	0,02
4,869 % éch. 25/06/2036		1 168	1 123	0,03
5,289 % éch. 25/05/2034		473	442	0,01
Centex Home Equity Loan Trust				
5,319 % éch. 25/09/2034		323	307	0,01
CIT Mortgage Loan Trust				
5,739 % éch. 25/10/2037		727	723	0,02
5,889 % éch. 25/10/2037		10 500	9 999	0,29
Citigroup Mortgage Loan Trust				
4,559 % éch. 25/07/2045		1 395	1 001	0,03
4,589 % éch. 25/05/2037		4 147	2 865	0,08
4,709 % éch. 25/12/2036		255	168	0,01
4,889 % éch. 25/08/2036		2 815	2 722	0,08
4,909 % éch. 25/09/2036		691	610	0,02
7,250 % éch. 25/05/2036		557	291	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,334 % éch. 25/10/2034		351	338	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
4,649 % éch. 25/03/2037		438	372	0,01
Clarinda Park CLO DAC				
2,698 % éch. 15/02/2034	€	7 550	7 774	0,22
Contego CLO DAC				
2,142 % éch. 23/01/2030		4 192	4 361	0,13
Countrywide Asset-Backed Certificates				
5,069 % éch. 25/12/2036 ^	$	91	67	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,483 % éch. 25/10/2032 ^		1 284	1 239	0,04
4,486 % éch. 25/07/2036		2 830	2 508	0,07
4,529 % éch. 25/06/2035		439	396	0,01
4,529 % éch. 25/07/2037		1 287	1 162	0,03
4,529 % éch. 25/08/2037 ^		164	142	0,00
4,539 % éch. 25/06/2047 ^		2	2	0,00
4,569 % éch. 25/11/2047 ^		60	66	0,00
4,589 % éch. 25/09/2037		660	571	0,02
4,589 % éch. 25/06/2047 ^		5 164	4 420	0,13
4,599 % éch. 25/05/2047 ^		1 929	1 707	0,05
4,609 % éch. 25/09/2037 ^		272	279	0,01
4,609 % éch. 25/09/2047 ^		1 948	1 857	0,05
4,619 % éch. 25/05/2037		258	242	0,01
5,484 % éch. 25/04/2036 ^		300	281	0,01
5,859 % éch. 25/10/2046 ^		23	23	0,00
6,095 % éch. 25/08/2035		154	151	0,00
6,114 % éch. 25/05/2035		893	877	0,03
6,339 % éch. 25/08/2035		1 485	1 336	0,04
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
4,598 % éch. 25/01/2032		2	2	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				
3,024 % éch. 25/12/2036 ^		586	458	0,01
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust				
3,241 % éch. 25/03/2037 ^		9 725	3 725	0,11

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				
2,909 % éch. 25/01/2037 ^	$	144	$ 46	0,00
3,039 % éch. 25/07/2036		2 109	1 962	0,06
3,103 % éch. 25/01/2037 ^		148	47	0,00
CSAB Mortgage-Backed Trust				
6,220 % éch. 25/09/2036 ^		3 542	1 193	0,03
CVC Cordatus Loan Fund DAC				
2,112 % éch. 21/07/2030	€	13 003	13 604	0,39
2,676 % éch. 15/09/2031		3 000	3 116	0,09
2,788 % éch. 26/08/2032		500	516	0,02
Delta Funding Home Equity Loan Trust				
5,138 % éch. 15/09/2029	$	5	5	0,00
Dryden Euro CLO DAC				
2,038 % éch. 15/04/2033	€	8 900	9 216	0,27
2,358 % éch. 17/01/2033		5 000	5 162	0,15
2,622 % éch. 15/05/2034		5 800	6 016	0,17
EMC Mortgage Loan Trust				
5,129 % éch. 25/05/2040	$	114	107	0,00
Euro-Galaxy CLO DAC				
2,122 % éch. 24/04/2034	€	3 800	3 934	0,11
Fieldstone Mortgage Investment Trust				
4,336 % éch. 25/11/2036	$	1 169	688	0,02
4,696 % éch. 25/04/2047		4 071	2 882	0,08
First Franklin Mortgage Loan Trust				
4,669 % éch. 25/12/2036		1 158	503	0,01
5,109 % éch. 25/11/2035		1 359	1 247	0,04
5,289 % éch. 25/07/2035		2 056	2 013	0,06
First NLC Trust				
4,569 % éch. 25/08/2037		7 091	3 362	0,10
Fremont Home Loan Trust				
4,519 % éch. 25/11/2036		1 904	710	0,02
4,524 % éch. 25/10/2036		3 565	3 147	0,09
4,589 % éch. 25/08/2036		630	218	0,01
4,669 % éch. 25/02/2037		7 713	5 971	0,17
4,729 % éch. 25/02/2037		1 707	610	0,02
4,889 % éch. 25/05/2036		1 319	770	0,02
5,004 % éch. 25/11/2035		6 788	5 934	0,17
5,124 % éch. 25/07/2035		152	151	0,00
5,259 % éch. 25/05/2034		1 622	1 495	0,04
Gallatin CLO Ltd.				
5,328 % éch. 21/01/2028		2 760	2 738	0,08
GE-WMC Mortgage Securities Trust				
4,689 % éch. 25/08/2036		10 369	4 661	0,13
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				
2,356 % éch. 20/01/2032	€	2 900	2 993	0,09
2,476 % éch. 20/07/2034		3 000	3 083	0,09
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				
5,498 % éch. 15/09/2037	$	6 412	6 315	0,18
Grosvenor Place CLO BV				
2,325 % éch. 30/10/2029	€	2 060	2 175	0,06
GSAA Home Equity Trust				
4,509 % éch. 25/05/2036	$	645	160	0,00
4,529 % éch. 25/03/2036		2 652	989	0,03
4,989 % éch. 25/05/2047		117	79	0,00
5,289 % éch. 25/08/2037		100	97	0,00
5,985 % éch. 25/06/2036		6 408	1 711	0,05
6,502 % éch. 25/11/2036		44	17	0,00
GSAMP Trust				
4,459 % éch. 25/12/2036		337	169	0,01
4,589 % éch. 25/11/2036		2 922	1 417	0,04
4,709 % éch. 25/04/2036		36	23	0,00
4,909 % éch. 25/06/2036		2 541	2 433	0,07
4,929 % éch. 25/04/2036		567	366	0,01
Harvest CLO DAC				
2,433 % éch. 18/11/2029	€	70	74	0,00
2,775 % éch. 26/06/2030		12 545	13 093	0,38
Home Equity Asset Trust				
5,379 % éch. 25/01/2035	$	65	65	0,00
5,484 % éch. 25/05/2035		176	173	0,01
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
4,549 % éch. 25/07/2037		800	433	0,01
4,609 % éch. 25/04/2037		933	724	0,02
4,629 % éch. 25/04/2037		930	615	0,02
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
4,579 % éch. 25/01/2037		890	639	0,02
4,609 % éch. 25/12/2036		4 278	1 171	0,03
4,829 % éch. 25/12/2036		3 884	1 058	0,03
4,914 % éch. 25/02/2036		7 100	6 024	0,17
5,169 % éch. 25/01/2036		9 668	8 313	0,24
IXIS Real Estate Capital Trust				
4,849 % éch. 25/01/2037	$	273	$ 108	0,00
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
4,442 % éch. 25/01/2037 ^		862	478	0,01
4,649 % éch. 25/06/2037		97	96	0,00
4,689 % éch. 25/07/2036		652	299	0,01
4,794 % éch. 25/05/2036		90	91	0,00
4,794 % éch. 25/07/2036		2 650	2 565	0,07
Jubilee CLO DAC				
2,028 % éch. 15/04/2031	€	3 100	3 215	0,09
LCM LP				
5,283 % éch. 20/10/2027	$	312	311	0,01
Lehman XS Trust				
4,292 % éch. 25/06/2036		841	830	0,02
4,709 % éch. 25/05/2036		1 962	1 657	0,05
Long Beach Mortgage Loan Trust				
4,499 % éch. 25/11/2036		9 535	2 964	0,09
4,829 % éch. 25/02/2036		1 798	1 736	0,05
4,989 % éch. 25/02/2036		268	220	0,01
5,034 % éch. 25/11/2035		708	702	0,02
5,304 % éch. 25/08/2035		700	627	0,02
Madison Park Euro Funding DAC				
2,128 % éch. 15/01/2032	€	9 800	10 126	0,29
Madison Park Funding Ltd.				
4,829 % éch. 15/04/2029	$	3 828	3 788	0,11
Man GLG Euro CLO DAC				
2,248 % éch. 15/01/2030	€	400	418	0,01
2,736 % éch. 15/12/2031		3 500	3 624	0,10
Massachusetts Educational Financing Authority				
5,308 % éch. 25/04/2038	$	555	553	0,02
MASTR Specialized Loan Trust				
4,739 % éch. 25/05/2037		78	68	0,00
4,759 % éch. 25/01/2037		1 236	496	0,01
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
4,536 % éch. 25/04/2037		1 431	724	0,02
4,649 % éch. 25/03/2037		2 547	2 274	0,07
4,709 % éch. 25/03/2037		897	804	0,02
4,729 % éch. 25/07/2037		59	27	0,00
4,869 % éch. 25/08/2037		12 020	6 438	0,19
4,909 % éch. 25/05/2037		1 117	666	0,02
4,974 % éch. 25/12/2036		6	6	0,00
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
4,449 % éch. 25/12/2036		1 160	607	0,02
4,519 % éch. 25/10/2036		684	602	0,02
4,529 % éch. 25/10/2036		27	13	0,00
4,529 % éch. 25/11/2036		732	366	0,01
4,529 % éch. 25/05/2037		3 082	2 701	0,08
4,539 % éch. 25/10/2036		6 780	3 355	0,10
4,539 % éch. 25/11/2036		1 114	673	0,02
4,539 % éch. 25/12/2036		237	124	0,00
4,569 % éch. 25/03/2037		1 092	494	0,01
4,609 % éch. 25/10/2036		1 097	527	0,02
4,619 % éch. 25/10/2036		4 009	1 991	0,06
4,639 % éch. 25/07/2036		755	639	0,02
4,639 % éch. 25/03/2037		546	247	0,01
4,689 % éch. 25/06/2036		15	13	0,00
4,689 % éch. 25/07/2036		1 542	628	0,02
4,689 % éch. 25/09/2036		66	25	0,00
5,169 % éch. 25/01/2035		1 179	1 134	0,03
5,439 % éch. 25/09/2033		69	68	0,00
5,639 % éch. 25/07/2037		2 100	1 748	0,05
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust				
4,749 % éch. 25/03/2036		1 124	907	0,03
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust				
4,689 % éch. 25/07/2036		1 602	692	0,02
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
6,465 % éch. 25/09/2046 ^		1 087	416	0,01
Navient Student Loan Trust				
5,439 % éch. 27/12/2066		3 963	3 898	0,11
New Century Home Equity Loan Trust				
5,109 % éch. 25/03/2035		552	528	0,02
Newcastle Investment Trust				
0,000 % éch. 01/05/2033		1 336	1 402	0,04
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				
4,539 % éch. 25/07/2036		1 947	1 833	0,05
4,719 % éch. 25/10/2036 ^		2 185	495	0,01
4,789 % éch. 25/02/2037 ^		591	188	0,01
5,274 % éch. 25/09/2035		157	156	0,00
NovaStar Mortgage Funding Trust				
4,549 % éch. 25/09/2037	$	719	$ 710	0,02
4,589 % éch. 25/09/2037		683	660	0,02
4,599 % éch. 25/01/2037		1 411	503	0,01
4,729 % éch. 25/11/2036		2 177	751	0,02
6,264 % éch. 25/03/2035		993	968	0,03
OCP Euro CLO DAC				
0,000 % éch. 20/01/2033 (b)	€	10 000	10 619	0,31
2,198 % éch. 15/01/2032		3 952	4 140	0,12
2,382 % éch. 22/09/2034		6 800	7 054	0,20
Octagon Investment Partners Ltd.				
5,049 % éch. 15/04/2031	$	850	838	0,02
Option One Mortgage Loan Trust				
4,529 % éch. 25/01/2037		859	576	0,02
4,529 % éch. 25/02/2037		840	565	0,02
4,529 % éch. 25/03/2037		154	138	0,00
4,609 % éch. 25/04/2037		4 728	3 378	0,10
4,609 % éch. 25/05/2037		3 827	2 334	0,07
5,124 % éch. 25/08/2035		125	125	0,00
Ownit Mortgage Loan Trust				
4,316 % éch. 25/05/2037		652	490	0,01
OZLM Ltd.				
5,674 % éch. 16/05/2030		4 452	4 384	0,13
OZLME DAC				
2,613 % éch. 24/08/2030	€	2 972	3 074	0,09
Palmer Square European Loan Funding DAC				
2,108 % éch. 15/07/2031		8 747	9 089	0,26
2,158 % éch. 15/04/2031		4 950	5 137	0,15
3,993 % éch. 12/04/2032		9 700	10 293	0,30
Palmerston Park CLO DAC				
2,053 % éch. 18/04/2030		1 911	2 005	0,06
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,334 % éch. 25/06/2035	$	730	723	0,02
5,709 % éch. 25/01/2036 ^		1 700	1 547	0,04
People's Choice Home Loan Securities Trust				
4,961 % éch. 25/05/2035 ^		3 022	2 697	0,08
5,366 % éch. 25/01/2035		460	435	0,01
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust				
4,599 % éch. 25/01/2037		1 058	1 019	0,03
RAAC Trust				
4,989 % éch. 25/06/2044		126	104	0,00
5,149 % éch. 25/10/2046		1 467	1 386	0,04
5,244 % éch. 25/03/2037		32	32	0,00
5,589 % éch. 25/10/2045		372	371	0,01
Red & Black Auto Germany				
2,246 % éch. 15/09/2031	€	2 386	2 553	0,07
Regatta Funding Ltd.				
5,149 % éch. 17/07/2031	$	1 000	983	0,03
Renaissance Home Equity Loan Trust				
3,269 % éch. 25/09/2037		719	509	0,02
5,089 % éch. 25/08/2032		10	9	0,00
5,612 % éch. 25/04/2037		3 152	953	0,03
Residential Asset Mortgage Products Trust				
5,129 % éch. 25/05/2037		2 718	2 371	0,07
Residential Asset Securities Corp. Trust				
4,729 % éch. 25/11/2036		2 039	1 894	0,05
4,729 % éch. 25/04/2037		2 878	2 697	0,08
4,909 % éch. 25/07/2036 ^		902	808	0,02
4,929 % éch. 25/07/2036		1 306	1 130	0,03
Saxon Asset Securities Trust				
4,559 % éch. 25/10/2046		310	301	0,01
Sculptor European CLO DAC				
2,153 % éch. 14/01/2032	€	6 100	6 336	0,18
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
4,709 % éch. 25/10/2036	$	9 878	3 519	0,10
5,049 % éch. 25/08/2035 ^		1 923	1 461	0,04
5,154 % éch. 25/02/2034		254	251	0,01
5,349 % éch. 25/01/2036 ^		260	247	0,01
SG Mortgage Securities Trust				
4,599 % éch. 25/10/2036		1 800	1 229	0,04
Sierra Madre Funding Ltd.				
4,597 % éch. 07/09/2039		2 024	1 501	0,04
4,617 % éch. 07/09/2039		11 613	8 614	0,25
SLM Student Loan Trust				
5,858 % éch. 25/04/2023		281	279	0,01
Soundview Home Loan Trust				
4,469 % éch. 25/06/2037		603	432	0,01

Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,509 % éch. 25/11/2036	$	271	$ 78	0,00
4,559 % éch. 25/07/2037		809	682	0,02
4,559 % éch. 25/08/2037		2 282	1 961	0,06
4,599 % éch. 25/06/2037		2 794	2 001	0,06
4,669 % éch. 25/06/2037		4 025	2 883	0,08
4,949 % éch. 25/10/2036		408	394	0,01
5,094 % éch. 25/03/2036		34	34	0,00
5,289 % éch. 25/10/2037		5 142	4 015	0,12
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust				
3,546 % éch. 25/09/2037		483	170	0,01
3,595 % éch. 25/02/2037 ^		1 542	616	0,02
4,353 % éch. 25/12/2036		1 083	1 026	0,03
St. Paul's CLO DAC				
2,128 % éch. 15/01/2032	€	1 298	1 357	0,04
Structured Asset Investment Loan Trust				
5,364 % éch. 25/01/2035	$	4 602	4 148	0,12
5,514 % éch. 25/01/2035		418	359	0,01
5,964 % éch. 25/01/2035		456	349	0,01
6,114 % éch. 25/01/2035 ^		311	113	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
4,544 % éch. 25/09/2036		7 470	4 723	0,14
4,569 % éch. 25/01/2037		858	502	0,01
4,889 % éch. 25/11/2037		2 220	2 051	0,06
5,394 % éch. 25/11/2035		6 700	6 565	0,19
5,620 % éch. 25/04/2035		76	74	0,00
Structured Asset Securities Corp. Trust				
5,079 % éch. 25/09/2035		4 368	4 133	0,12
Symphony CLO Ltd.				
4,959 % éch. 15/04/2028		495	491	0,01
TICP CLO Ltd.				
5,083 % éch. 20/04/2028		2 570	2 563	0,07
Tikehau CLO DAC				
2,596 % éch. 04/08/2034	€	500	518	0,02
Toro European CLO DAC				
2,239 % éch. 12/01/2032		6 200	6 375	0,18
2,298 % éch. 15/07/2030		668	700	0,02
Triaxx Prime CDO Ltd.				
4,402 % éch. 02/10/2039	$	1 842	47	0,00
Voya Euro CLO DAC				
2,128 % éch. 15/10/2030	€	2 249	2 350	0,07
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				
4,539 % éch. 25/01/2037	$	10 154	4 671	0,13
4,614 % éch. 25/05/2037		3 442	3 135	0,09
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust				
4,689 % éch. 25/05/2036		870	670	0,02
4,869 % éch. 25/05/2036		711	550	0,02
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
4,689 % éch. 25/04/2037		2 967	2 017	0,06
6,114 % éch. 25/11/2035		6 389	6 259	0,18
Willow Park CLO DAC				
2,218 % éch. 15/01/2031	€	1 000	1 043	0,03
			627 110	**18,00**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement argentin				
0,500 % éch. 09/07/2030	$	3 875	1 007	0,03
1,000 % éch. 09/07/2029		483	129	0,00
1,500 % éch. 09/07/2035		10 189	2 570	0,07
15,500 % éch. 17/10/2026	ARS	17 300	14	0,00
Obligations du Trésor argentin BONCER				
1,400 % éch. 25/03/2023		1 179 122	3 581	0,10
Obligation internationale du gouvernement israélien				
2,750 % éch. 03/07/2030	$	4 000	3 643	0,11
3,800 % éch. 13/05/2060		4 600	3 618	0,10
Letras de la Nacion Argentina con Ajuste por CER				
0,000 % éch. 19/05/2023 (e)	ARS	558 519	1 697	0,05
Obligation internationale du gouvernement péruvien				
5,940 % éch. 12/02/2029	PEN	16 700	4 020	0,12
6,350 % éch. 12/08/2028		8 300	2 071	0,06
8,200 % éch. 12/08/2026		11 900	3 268	0,09
Provincia de Buenos Aires				
72,913 % éch. 12/04/2025 (a)	ARS	315 510	874	0,03
Obligation internationale du gouvernement de la République hellénique				
1,875 % éch. 24/01/2052	€	1 700	1 038	0,03
3,500 % éch. 30/01/2023		154	165	0,01
3,750 % éch. 30/01/2028	€	360	$ 384	0,01
3,900 % éch. 30/01/2033 (k)		2 035	2 077	0,06
4,000 % éch. 30/01/2037		1 120	1 122	0,03
Obligation internationale du gouvernement roumain				
1,750 % éch. 13/07/2030		5 100	3 803	0,11
Obligation internationale du gouvernement russe				
4,250 % éch. 23/06/2027 ^	$	400	140	0,00
4,750 % éch. 27/05/2026 ^		400	140	0,00
5,250 % éch. 23/06/2047 ^		800	296	0,01
5,625 % éch. 04/04/2042 ^		200	127	0,00
Obligation internationale du gouvernement sud-africain				
4,850 % éch. 30/09/2029		10 100	9 040	0,26
10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	894 100	55 553	1,60
Obligation internationale du gouvernement turc				
5,750 % éch. 22/03/2024	$	1 800	1 788	0,05
6,350 % éch. 10/08/2024		9 400	9 312	0,27
			111 477	**3,20**

DESCRIPTION		ACTIONS		
ACTIONS ORDINAIRES				
ÉNERGIE				
Constellation Oil Services Holding S.A. « B » (d)(j)		1 038 200	113	0,00
SERVICES FINANCIERS				
Intelsat Emergence S.A. (d)(j)		19 324	464	0,01
National Bank of Greece S.A. (d)		307 710	1 230	0,04
			1 694	0,05
			1 807	**0,05**
DROITS				
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05/12/2025		4 046	29	0,00
BONS DE SOUSCRIPTION				
Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10/06/2071 (j)		1	0	0,00
TITRES PRIVILÉGIÉS				
Nationwide Building Society 10,250 %		38 168	5 750	0,17

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BILLETS DE TRÉSORERIE				
American Electric Power Co., Inc. 4,800 % éch. 19/01/2023	$	4 750	4 738	0,14
Constellation Brands, Inc. 5,000 % éch. 12/01/2023		1 200	1 198	0,03
Targa Resources Corp. 5,250 % éch. 13/01/2023		5 750	5 740	0,16
			11 676	**0,33**
BILLETS À COURT TERME				
Federal Home Loan Bank 4,310 % éch. 04/01/2023		32 300	32 300	0,93
4,320 % éch. 24/01/2023		35 200	35 200	1,01
4,325 % éch. 06/02/2023		35 000	35 001	1,00
4,340 % éch. 10/02/2023		32 600	32 601	0,94
4,345 % éch. 23/02/2023		23 700	23 701	0,68
			158 803	**4,56**
BONS DU TRÉSOR HONGROIS				
18,250 % éch. 03/01/2023 (e)(f)	HUF	8 175 000	21 787	0,63

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS				
(0,190) % éch. 20/03/2023 (e)(f)	¥	10 600 000	$ 80 366	2,31
(0,162) % éch. 23/01/2023 (e)(f)		8 650 000	65 564	1,88
(0,151) % éch. 23/01/2023 (e)(f)		10 000 000	75 797	2,17
			221 727	**6,36**
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
3,568 % éch. 24/01/2023 (e)(f)	$	13 200	13 170	0,39
4,317 % éch. 09/03/2023 (e)(f)		8 100	8 038	0,23
			21 208	**0,62**
Total des Instruments à court terme			435 201	12,50
Total des Valeurs mobilières			**$ 2 712 201**	**77,87**

DESCRIPTION	ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (h)	1 496 908	13 173	0,38
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (h)	770 713	7 037	0,20
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds US Short-Term Fund (h)	9 356 514	93 378	2,68
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)	10 402 960	103 551	2,97
		217 139	**6,23**
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (h)	1 328 250	131 583	3,77
Total des Fonds d'investissement		**$ 348 722**	**10,00**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BRC	4,270 %	03/01/2023	04/01/2023	$ 535 400	Freddie Mac 4,000 % échéance 01/07/2052	$ (139 541)	$ 535 400	$ 535 464	15,37
					Ginnie Mae 2,500 % - 4,500 % échéance 20/01/2052 - 20/12/2052	(413 154)			
	4,280	30/12/2022	03/01/2023	520 300	Obligations du Trésor américain 3,125 % - 4,750 % échéance 15/02/2041 -15/05/2048	(529 681)	520 300	520 547	14,94
FICC	1,900	30/12/2022	03/01/2023	2 892	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 08/06/2023	(2 950)	2 892	2 892	0,08
SAL	4,320	30/12/2022	03/01/2023	87 100	Billets du Trésor américain 0,125 % échéance 15/10/2023	(88 769)	87 100	87 142	2,50
Total des Contrats de mise en pension						**$ (1 174 095)**	**$ 1 145 692**	**$ 1 146 045**	**32,89**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2024	2 110	$ 9 921	0,29
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023 (1)	Court	01/2023	58	46	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Long	03/2023	453	(1 749)	(0,05)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	Long	03/2023	658	(5 675)	(0,16)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	546	4 907	0,13
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023 (1)	Court	01/2023	58	(297)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Long	03/2023	2 230	(2 345)	(0,07)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	4 743	(973)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	1 402	(1 479)	(0,04)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Court	03/2023	573	(23)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Long	03/2023	20	(3)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	877	621	0,02
				$ 2 951	0,08

(1) Option de style contrat à terme standardisé.

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Nbre de Contrats	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	$ 98,000	15/12/2023	4	$ (3)	$ (1)	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	4	(4)	(11)	0,00
				$ (7)	$ (12)	0,00
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					**$ 2 939**	**0,08**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

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

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel(3)	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AES Corp.	5,000 %	20/12/2025	$ 500	$ (39)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2024	5 300	24	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	3 000	(53)	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20/03/2023	1 600	(23)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2023	6 100	(12)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2026	100	0	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2024	€ 7 000	26	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	$ 4 300	(20)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2026	400	(3)	0,00
Stellantis NV	5,000	20/06/2026	€ 3 000	(332)	(0,01)
Stellantis NV	5,000	20/12/2026	4 600	(423)	(0,01)
Tesco PLC	1,000	20/06/2028	4 300	(106)	(0,01)
Valeo S.A.	1,000	20/06/2026	1 000	(25)	0,00
Valeo S.A.	1,000	20/06/2028	400	(24)	0,00
				$ (1 010)	(0,03)

Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION[2]

Indices/Tranches	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.EM-33 à 5 ans	(1,000) %	20/06/2025	$ 87	$ (5)	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.HY-37 à 5 ans	5,000 %	20/12/2026	$ 396	$ (18)	0,00
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000	20/12/2027	2 500	96	0,00
Indice CDX.IG-35 à 5 ans	1,000	20/12/2025	200	(2)	0,00
Indice CDX.IG-36 à 5 ans	1,000	20/06/2026	700	(8)	0,00
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000	20/12/2027	3 500	26	0,00
Indice iTraxx Crossover 38 à 5 ans	5,000	20/12/2027	€ 16 500	780	0,03
				$ 874	0,03

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	0,500 %	07/02/2023	£ 63 600	$ (905)	0,02
À payer[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2033	70 300	(677)	(0,02)
À recevoir[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250	15/03/2028	81 900	2 927	0,08
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	21/12/2052	$ 24 100	1 610	0,05
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,853	18/05/2032	22 200	(2 910)	(0,08)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,857	15/07/2032	36 600	(4 781)	(0,15)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,350	14/12/2032	25 900	573	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	10,206	04/01/2027	BRL 13 900	(182)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,045	04/01/2027	136 700	(1 111)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,050	04/01/2027	126 600	(1 026)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,086	04/01/2027	82 400	(667)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,098	04/01/2027	126 200	(1 014)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,115	04/01/2027	271 000	(330)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,460	04/01/2027	145 000	(772)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,734	02/01/2025	127 000	(416)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,800	02/01/2025	128 000	(392)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,814	04/01/2027	76 300	(311)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,835	02/01/2025	129 000	(381)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,868	04/01/2027	68 000	(259)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,500	04/01/2027	185 800	(99)	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,000	14/11/2023	CAD 54 100	(1 129)	(0,03)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,060	28/10/2023	516 600	(8 275)	(0,25)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	1,750	15/12/2026	KRW 160 467 700	(8 804)	(0,26)
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	1,750	15/12/2031	81 913 000	8 176	0,23
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	2,000	15/12/2026	67 230 600	(3 503)	(0,11)
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	2,000	15/12/2031	35 676 700	3 288	0,09
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,000	01/11/2023	NZD 144 800	(1 979)	(0,06)
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,000	15/12/2023	203 200	(3 009)	(0,09)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,270	04/11/2023	$ 345 100	(12 018)	(0,35)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	10/12/2029	40	5	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,250	20/06/2028	104 830	2 302	0,07
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	€ 3 000	(129)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027	6 700	(687)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	11/05/2027	5 800	(592)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027	3 400	(341)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	7 200	(637)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	3 500	(309)	(0,01)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	41 720	(280)	(0,01)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,160	16/09/2027	PLN 93 100	100	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,210	26/04/2027	116 600	(772)	(0,02)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,240	23/09/2027	78 600	19	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,250	23/09/2027	55 300	8	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,270	20/09/2027	89 800	(2)	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,280	26/09/2027	26 700	(4)	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,310	19/09/2027	94 800	(38)	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,985	11/10/2027	113 000	(799)	(0,02)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	7,156	13/10/2027	58 300	(509)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,660	24/03/2023	MXN 435 510	(271)	(0,01)
					$ (41 312)	(1,19)

Total des Instruments financiers dérivés compensés **$ (41 453)** **(1,19)**

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

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

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

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

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

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

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	0,023 %	29/06/2023	17 500	$ 931	$ 3 831	0,11
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	0,021	25/10/2023	7 600	434	1 916	0,06
FAR	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	0,021	15/09/2023	12 200	640	2 944	0,08
MYC	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	0,021	15/09/2023	12 800	696	3 154	0,09
							$ 2 701	$ 11 845	0,34

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente - Indice iTraxx Europe 37 à 5 ans hors cote	Vente	3,000 %	15/03/2023	17 200	$ (30)	$ (3)	0,00

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	0,021 %	29/06/2023	85 800	$ (932)	$ (6 729)	(0,19)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	0,020	25/10/2023	38 000	(435)	(2 995)	(0,09)
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	31/03/2023	140 000	(234)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	31/03/2023	140 000	(308)	(2 149)	(0,06)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	28/04/2023	9 000	(16)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	28/04/2023	9 000	(16)	(128)	(0,01)
FAR	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	0,020	15/09/2023	61 000	(640)	(4 926)	(0,14)
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	3 700	(24)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	3 700	(24)	(47)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	3 700	(26)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	3 700	(26)	(44)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	3 700	(26)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	3 700	(26)	(42)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	3 700	(26)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	3 700	(26)	(41)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	3 700	(25)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	3 700	(25)	(48)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	3 700	(25)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	3 700	(25)	(52)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	10 800	(34)	(9)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	10 800	(34)	(75)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,500	07/02/2023	331 900	(1 145)	(9 893)	(0,29)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	26/04/2023	8 800	(15)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	26/04/2023	8 800	(15)	(125)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	12 800	(150)	(33)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	12 800	(177)	(419)	(0,01)
MYC	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	0,020	15/09/2023	64 000	(696)	(5 230)	(0,15)
							$ (5 151)	$ (33 014)	(0,95)

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	$ 101,891	05/01/2023	9 600	$ (29)	$ 0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	99,813	06/02/2023	3 000	(20)	(19)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	100,000	06/02/2023	2 000	(14)	(14)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	101,813	06/02/2023	3 000	(18)	(6)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	102,000	06/02/2023	2 000	(12)	(4)	0,00
JPM	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	97,000	06/03/2023	4 100	(35)	(63)	(0,01)
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	99,000	06/03/2023	4 100	(30)	(10)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	98,766	06/03/2023	3 400	(29)	(46)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	100,766	06/03/2023	3 400	(24)	(11)	0,00

Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
SAL	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	$ 101,859	05/01/2023	5 200	$ (16)	$ 0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	99,750	06/02/2023	4 700	(33)	(29)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	101,750	06/02/2023	4 700	(27)	(11)	0,00
					$ (287)	$ (213)	(0,01)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000 %	20/12/2023	$ 2 100	$ (154)	$ 104	$ (50)	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	200	(13)	8	(5)	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2023	100	(6)	6	0	0,00
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2024	100	(2)	2	0	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2024	400	(6)	5	(1)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/06/2024	15 500	(686)	657	(29)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2024	300	(37)	24	(13)	0,00
HUS	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2023	200	(6)	7	1	0,00
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2024	1 700	(50)	49	(1)	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	200	(12)	13	1	0,00
MYC	Obligations de l'État de Californie, General Obligation, Series 2003	1,000	20/09/2024	2 900	23	18	41	0,00
					$ (949)	$ 893	$ (56)	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17/11/2059	$ 800	$ (24)	$ 22	$ (2)	0,00
MYC	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	11 000	(379)	355	(24)	0,00
UAG	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	10 900	(378)	354	(24)	0,00
					$ (781)	$ 731	$ (50)	0,00

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

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

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	1,000 %	15/12/2026	THB 3 038 630	$ 3 969	$ 33	$ 4 002	0,11
	À payer	THORON THB composé-OIS à 3 mois	1,500	15/12/2031	1 576 870	(3 599)	19	(3 580)	(0,10)
GLM	À recevoir	THBFIX THB à 6 mois	1,000	15/12/2026	3 356 200	245	4 218	4 463	0,13
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	1,500	15/12/2031	1 728 000	(545)	(3 599)	(4 144)	(0,12)
						$ 70	$ 671	$ 741	0,02

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 315	$ 389	$ 10	$ 0	$ 10	0,00
	01/2023	HUF 325 540	831	0	(36)	(36)	0,00
	01/2023	PLN 4 737	1 080	1	0	1	0,00
	01/2023	$ 817	PLN 3 619	7	0	7	0,00
	01/2023	ZAR 954	$ 54	0	(2)	(2)	0,00
	02/2023	PEN 21 133	5 382	0	(140)	(140)	0,00
	02/2023	ZAR 70 456	3 931	0	(194)	(194)	(0,01)
BPS	01/2023	£ 247	298	1	0	1	0,00
	01/2023	HUF 1 437 424	3 761	0	(70)	(70)	0,00
	01/2023	PEN 7 605	1 968	0	(26)	(26)	0,00
	01/2023	$ 181	ILS 620	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	71	ZAR 1 230	1	0	1	0,00
	02/2023	ZAR 225 990	$ 12 590	0	(646)	(646)	(0,02)
	03/2023	CLP 6 614 249	6 850	0	(830)	(830)	(0,02)
	03/2023	MXN 29 003	1 439	0	(29)	(29)	0,00
	03/2023	PEN 13 874	3 568	0	(46)	(46)	0,00
	03/2023	$ 1 130	INR 93 753	0	(3)	(3)	0,00
	03/2023	3 924	PEN 15 187	34	0	34	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BRC	01/2023	CNH	2 769	$	397	$ 0	$ (4)	$ (4)	0,00
	01/2023	HUF	2 653 088		6 919	0	(152)	(152)	0,00
	01/2023	PLN	7 710		1 534	0	(223)	(223)	(0,01)
	01/2023	$	1 151	£	942	0	(18)	(18)	0,00
	01/2023		1 616	PEN	6 226	13	0	13	0,00
	01/2023		1 705	PLN	7 565	22	(3)	19	0,00
CBK	01/2023	CLP	6 666 741	$	7 494	0	(325)	(325)	(0,01)
	01/2023	€	4 232		4 483	0	(35)	(35)	0,00
	01/2023	PLN	36 187		7 903	0	(342)	(342)	(0,01)
	01/2023	$	6 994	CLP	6 664 493	822	0	822	0,02
	01/2023		1 815	€	1 745	49	0	49	0,00
	01/2023		4 974	PLN	23 847	459	0	459	0,01
	01/2023		1 364	ZAR	23 901	38	0	38	0,00
	02/2023	NZD	6 505	$	3 947	0	(170)	(170)	(0,01)
	02/2023	PEN	42 510		10 571	0	(524)	(524)	(0,02)
	02/2023	$	19 792	BRL	106 815	329	0	329	0,01
	02/2023		7 494	CLP	6 703 462	331	0	331	0,01
	03/2023	PEN	17 814	$	4 556	0	(85)	(85)	0,00
	04/2023		18 521		4 596	0	(219)	(219)	(0,01)
	04/2023	$	1 681	PEN	6 724	67	0	67	0,00
CLY	01/2023	HUF	2 282 900	$	5 832	0	(252)	(252)	(0,01)
	03/2023	$	1 889	PEN	7 265	4	0	4	0,00
DUB	02/2023	ZAR	18 230	$	1 092	24	0	24	0,00
GLM	01/2023	CNH	2 874		413	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	HKD	1 261		162	0	0	0	0,00
	01/2023	HUF	768 723		1 969	0	(80)	(80)	0,00
	01/2023	PLN	236 064		47 053	0	(6 732)	(6 732)	(0,19)
	01/2023	$	6 103	PLN	28 782	455	0	455	0,01
	01/2023	ZAR	71 975	$	4 026	0	(198)	(198)	(0,01)
	02/2023	$	2 235	COP	10 180 350	0	(155)	(155)	0,00
	03/2023	MXN	43 610	$	2 121	0	(86)	(86)	0,00
	05/2023	ZAR	32 040		1 917	54	0	54	0,00
JPM	01/2023	£	143 906		173 770	638	0	638	0,02
	01/2023	HUF	136 259		348	0	(16)	(16)	0,00
	01/2023	$	1 178	CNY	8 201	10	0	10	0,00
	02/2023	TWD	339	$	11	0	0	0	0,00
	02/2023	ZAR	649		36	0	(2)	(2)	0,00
	03/2023	$	2 116	CNY	14 639	12	0	12	0,00
MBC	01/2023	CAD	846	$	631	6	0	6	0,00
	01/2023	DKK	3 305		462	0	(12)	(12)	0,00
	01/2023	€	131 348		137 689	0	(2 552)	(2 552)	(0,07)
	01/2023	£	123		150	2	0	2	0,00
	01/2023	HKD	5 232		672	2	0	2	0,00
	01/2023	$	214	AUD	320	3	0	3	0,00
	01/2023		6 012	¥	827 832	266	0	266	0,01
	01/2023		2 412	PLN	11 784	273	0	273	0,01
	05/2023		813	CNH	5 456	0	(17)	(17)	0,00
MYI	01/2023	€	27	$	29	0	0	0	0,00
	01/2023	£	714		860	1	0	1	0,00
	01/2023	PLN	13 301		2 727	0	(303)	(303)	(0,01)
	01/2023	$	6 813	AUD	10 145	69	0	69	0,00
	01/2023		7	€	6	0	0	0	0,00
	01/2023		677	£	562	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		28 819	¥	3 950 983	1 145	0	1 145	0,03
	01/2023		2 156	PLN	10 712	285	0	285	0,01
	02/2023	TWD	627	$	21	0	0	0	0,00
RBC	01/2023	PLN	5 174		1 128	0	(51)	(51)	0,00
	01/2023	$	78	AUD	117	1	0	1	0,00
	01/2023		1 048	£	868	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023		55	ZAR	954	1	0	1	0,00
	03/2023		4	MXN	88	0	0	0	0,00
	04/2023	MXN	20 661	$	997	0	(43)	(43)	0,00
RYL	01/2023	€	9 901		10 495	0	(76)	(76)	0,00
SCX	01/2023		416 834		433 861	0	(11 194)	(11 194)	(0,32)
	01/2023	KRW	358 220		271	0	(14)	(14)	0,00
	01/2023	$	458	AUD	680	3	0	3	0,00
	01/2023		1 978	PEN	7 591	12	0	12	0,00
	02/2023	NZD	1 685	$	1 024	0	(42)	(42)	0,00
	02/2023	TWD	3 794		123	0	(1)	(1)	0,00
	03/2023	$	2 059	PEN	7 922	6	0	6	0,00
SSB	03/2023	¥	10 600 000	$	79 025	0	(2 124)	(2 124)	(0,06)
TOR	01/2023		18 650 000		128 371	0	(13 313)	(13 313)	(0,38)
UAG	01/2023	HUF	545 760		1 423	0	(32)	(32)	0,00
	01/2023	PLN	5 095		1 136	0	(25)	(25)	0,00
	01/2023	$	1 142	£	922	0	(32)	(32)	0,00
	01/2023		2 698	ZAR	46 940	57	0	57	0,00
	01/2023	ZAR	226 459	$	12 643	0	(650)	(650)	(0,02)
	03/2023		1 224		68	0	(3)	(3)	0,00
						$ 5 513	$ (42 140)	$ (36 627)	(1,05)

Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Z en AUD (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	AUD	54	$	36	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$	5 132	AUD	7 619	36	0	36	0,00
BOA	01/2023		20		29	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	AUD	101	$	68	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	133	AUD	196	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	AUD	26	$	18	0	0	0	0,00
	01/2023	$	1 780	AUD	2 655	21	0	21	0,00
MYI	01/2023		5 511		8 206	55	0	55	0,01
RBC	01/2023		895		1 335	10	0	10	0,00
TOR	01/2023		4 982		7 382	25	0	25	0,00
						$ 147	$ (1)	$ 146	0,01

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CAD (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	2 930	CAD	3 961	$ 0	$ (6)	$ (6)	0,00
CBK	01/2023		2 093		2 829	0	(6)	(6)	0,00
MBC	01/2023		3 023		4 092	0	(2)	(2)	0,00
MYI	01/2023	CAD	48	$	36	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	$	839	CAD	1 128	0	(7)	(7)	0,00
						$ 0	$ (21)	$ (21)	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	31 139	CHF	29 456	$ 719	$ 0	$ 719	0,02
CBK	01/2023	CHF	106	$	113	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	52 517	CHF	49 623	1 153	0	1 153	0,03
MYI	01/2023	CHF	71	$	75	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$	637	CHF	593	4	0	4	0,00
SCX	01/2023	CHF	43	$	46	0	0	0	0,00
	01/2023	$	54	CHF	50	0	0	0	0,00
						$ 1 876	$ (3)	$ 1 873	0,05

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation et G Détail en EUR (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€	1 063	$	1 121	$ 0	$ (14)	$ (14)	0,00
BPS	01/2023		200		213	0	0	0	0,00
	01/2023	$	124	€	116	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	€	5 368	$	5 604	0	(128)	(128)	0,00
	01/2023	$	101 215	€	97 603	2 997	0	2 997	0,09
MBC	01/2023	€	1 762	$	1 876	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	$	101 154	€	96 515	1 895	0	1 895	0,05
SCX	01/2023		100 529		96 583	2 594	0	2 594	0,07
						$ 7 486	$ (147)	$ 7 339	0,21

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution et E en GBP (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£	8 547	$	10 499	$ 216	$ 0	$ 216	0,01
	01/2023	$	19 649	£	16 319	0	(16)	(16)	0,00
BPS	01/2023		1 209		1 002	0	(4)	(4)	0,00
BRC	01/2023	£	219	$	264	0	0	0	0,00
	01/2023	$	398	£	331	0	0	0	0,00
CLY	01/2023		168		138	0	(2)	(2)	0,00
JPM	01/2023		766 940		635 133	0	(2 816)	(2 816)	(0,08)
MBC	01/2023	£	234	$	287	5	0	5	0,00
	01/2023	$	788 369	£	657 612	3 298	(500)	2 798	0,08
MYI	01/2023		3 935		3 222	0	(58)	(58)	0,00
TOR	01/2023		764 079		635 520	511	0	511	0,01
UAG	01/2023	£	920	$	1 131	24	0	24	0,00
	01/2023	$	259	£	209	0	(7)	(7)	0,00
						$ 4 054	$ (3 403)	$ 651	0,02

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BRC	01/2023	$ 122	NOK 1 218	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
CBK	01/2023	136	1 346	1	0	1	0,00
MBC	01/2023	4	43	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	139	1 382	1	0	1	0,00
TOR	01/2023	10	103	0	0	0	0,00
				$ 3	$ 0	$ 3	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	SEK 1 618	$ 159	$ 3	$ 0	$ 3	0,00
	01/2023	$ 1	SEK 6	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	1 843	19 303	10	0	10	0,00
CBK	01/2023	SEK 45	$ 4	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 56	SEK 589	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	SEK 110	$ 11	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 3	SEK 34	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	699	7 356	7	0	7	0,00
SCX	01/2023	SEK 182	$ 18	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	98	9	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 3 474	SEK 36 434	26	(1)	25	0,00
				$ 46	$ (1)	$ 45	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ (47 341)**	**(1,36)**

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
2,000 % éch. 01/01/2053	$ 70 458	$ (57 348)	(1,65)
2,000 % éch. 01/02/2053	30 442	(24 804)	(0,71)
Total des Titres vendus à découvert		**$ (82 152)**	**(2,36)**
Total des Investissements		**$ 4 038 608**	**115,93**
Autres actifs et passifs à court terme		**$ (555 007)**	**(15,93)**
Actif net		**$ 3 483 601**	**100,00**

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

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

^ **Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.**

(a) **Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).**

(b) **Titre vendu avant l'émission.**

(c) **Titre à rémunération en nature.**

(d) **Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.**

(e) **Titre à coupon zéro.**

(f) **Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.**

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

(h) **Affilié au Fonds.**

(i) **Titre convertible conditionnel.**

(j) **Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,08 %) :**

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
ADLER Group S.A. 12,500 % échéance 31/07/2025	22/12/2022	$ 3 308	$ 3 308	0,10
Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10/06/2071	10/06/2022	0	0	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. « B »	10/06/2022	113	113	0,00
Deutsche Bank AG 0,898 % échéance 28/05/2024	25/05/2021	1 900	1 778	0,05
Deutsche Bank AG 3,035 % échéance 28/05/2032	25/05/2021	800	608	0,02
Intelsat Emergence S.A.	05/09/2018	2 000	464	0,01
Morgan Stanley 0,000 % échéance 02/04/2032	29/07/2022	2 405	2 056	0,06
		$ 10 526	$ 8 327	0,24

Tableau des investissements Fonds Dynamic Bond Fund (suite)

(k) Un titre d'une juste valeur globale de 2 041 $ (31 décembre 2021 : 4 463 $) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 0 $ (31 décembre 2021 : 250 $) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 45 907 $ (31 décembre 2021 : 48 680 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 10 143 $) et un montant en numéraire de 48 797 $ (31 décembre 2021 : 2 620 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 2 707 373	$ 4 828	$ 2 712 201
Fonds d'investissement	217 139	131 583	0	348 722
Contrats de mise en pension	0	1 145 692	0	1 145 692
Instruments financiers dérivés[3]	(2 766)	(83 089)	0	(85 855)
Titres vendus à découvert	0	(82 152)	0	(82 152)
Totaux	**$ 214 373**	**$ 3 819 407**	**$ 4 828**	**$ 4 038 608**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 2 891 918	$ 8 148	$ 2 900 066
Fonds d'investissement	318 072	0	0	318 072
Contrats de mise en pension	0	9 965	0	9 965
Instruments financiers dérivés[3]	616	(23 878)	0	(23 262)
Titres vendus à découvert	0	(262 976)	0	(262 976)
Totaux	**$ 318 688**	**$ 2 615 029**	**$ 8 148**	**$ 2 941 865**

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

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

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

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	En % de l'actif net
DBL	(0,500) %	01/12/2022	TBD[1]	€ (2 028)	$ (2 164)	(0,06)
Total des Contrats de prise en pension					**$ (2 164)**	**(0,06)**

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ 36	$ 0	$ 36	$ S/O	$ S/O	$ S/O
BOA	(3 100)	3 170	70	408	(120)	288
BPS	(3 900)	3 880	(20)	731	(690)	41
BRC	(359)	320	(39)	8 264	(5 239)	3 025
CBK	4 410	(4 530)	(120)	(1 354)	1 451	97
CLY	(250)	0	(250)	S/O	S/O	S/O
DBL	S/O	S/O	S/O	20	0	20
DUB	24	(100)	(76)	(149)	0	(149)
FAR	(1 982)	1 690	(292)	(199)	290	91
FBF	S/O	S/O	S/O	29	0	29
GLM	(17 283)	17 179	(104)	(4 744)	4 555	(189)
GSC	S/O	S/O	S/O	(29)	0	(29)
GST	(48)	208	160	(99)	0	(99)
HUS	S/O	S/O	S/O	(1 843)	1 483	(360)
JPM	(2 303)	310	(1 993)	8 674	(7 190)	1 484
MBC	2 683	(3 440)	(757)	S/O	S/O	S/O
MYC	(2 059)	1 970	(89)	(48)	(699)	(747)
MYI	1 202	(910)	292	1 079	(480)	599

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
RBC	$ (86)	$ 60	$ (26)	$ 1 725	$ (1 380)	$ 345
RYL	(76)	0	(76)	(1)	0	(1)
SAL	(40)	0	(40)	(117)	290	173
SCX	(8 642)	8 280	(362)	(2 647)	2 654	7
SSB	(2 124)	1 540	(584)	S/O	S/O	S/O
TOR	(12 777)	9 630	(3 147)	(3 468)	2 040	(1 428)
UAG	(667)	560	(107)	8 649	(6 430)	2 219

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	30,35	48,92
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	46,36	36,87
Autres valeurs mobilières	1,16	2,70
Fonds d'investissement	10,00	9,70
Contrats de mise en pension	32,89	0,30
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,08	(0,01)
Instruments financiers dérivés compensés	(1,19)	(1,16)
Instruments financiers dérivés hors cote	(1,36)	0,45
Titres vendus à découvert	(2,36)	(8,02)
Contrats de prise en pension	(0,06)	(0,14)

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Crédits consortiaux et cessions	1,91	2,47
Obligations et billets privés	22,11	34,52
Obligations et billets convertibles	0,40	0,50
Obligations et billets municipaux	0,35	0,44
Agences du gouvernement américain	8,36	2,49
Obligations du Trésor américain	2,61	12,45
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	8,21	6,38
Titres adossés à des actifs	18,00	16,61
Émissions souveraines	3,20	5,36
Actions ordinaires	0,05	0,03
Droits	0,00	S/O
Bons de souscription	0,00	S/O
Titres privilégiés	0,17	0,30
Instruments à court terme	12,50	6,94
Fonds d'investissement	10,00	9,70
Contrats de mise en pension	32,89	0,30
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,08	(0,01)
Options vendues		
Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse	0,00	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,03)	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection	0,00	(0,05)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,03	0,01
Swaps de taux d'intérêt	(1,19)	(1,12)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,34	0,07
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,95)	(0,15)
Options sur titres	(0,01)	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,00	0,01
Swaps de taux d'intérêt	0,02	0,01
Contrats de change à terme	(1,05)	(0,32)
Contrats de change à terme couverts	0,29	0,83
Titres vendus à découvert	(2,36)	(8,02)
Autres actifs et passifs à court terme	(15,93)	10,25
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Dynamic Multi-Asset Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
BANQUE ET FINANCE					
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.					
5,875 % éch. 24/09/2023 (e)(g)	€	1 200	€	1 157	0,02
Bank of America Corp.					
0,750 % éch. 26/07/2023		15 000		14 853	0,29
2,243 % éch. 25/04/2024		4 500		4 501	0,09
Barclays PLC					
1,500 % éch. 03/09/2023		7 000		6 933	0,14
7,250 % éch. 15/03/2023 (e)(g)	£	1 200		1 340	0,03
7,750 % éch. 15/09/2023 (e)(g)	$	2 400		2 201	0,04
CaixaBank S.A.					
6,750 % éch. 13/06/2024 (e)(g)	€	400		391	0,01
Cajamar Caja Rural SCC					
0,875 % éch. 18/06/2023		1 700		1 686	0,03
Castellum AB					
2,125 % éch. 20/11/2023		2 600		2 498	0,05
Commerzbank AG					
0,125 % éch. 09/01/2024		5 500		5 334	0,11
Credit Suisse AG					
2,984 % éch. 01/09/2023		5 000		4 916	0,10
6,500 % éch. 08/08/2023 (g)	$	200		182	0,00
Credit Suisse Group AG					
6,250 % éch. 18/12/2024 (e)(g)		400		295	0,01
7,500 % éch. 17/07/2023 (e)(g)		1 000		751	0,02
7,500 % éch. 11/12/2023 (e)(g)		2 000		1 641	0,03
Deutsche Bank AG					
1,125 % éch. 30/08/2023	€	1 600		1 583	0,03
Digital Euro Finco LLC					
2,500 % éch. 16/01/2026		900		835	0,02
DNB Boligkreditt A/S					
0,375 % éch. 14/11/2023		3 800		3 713	0,07
Erste Group Bank AG					
6,500 % éch. 15/04/2024 (e)(g)		600		587	0,01
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial					
0,250 % éch. 25/04/2023		5 000		4 969	0,10
Fonds européen de stabilité financière					
0,000 % éch. 19/04/2024 (c)		15 000		14 455	0,28
Goldman Sachs Group, Inc.					
2,732 % éch. 07/02/2025		17 700		17 662	0,35
HSBC Holdings PLC					
6,000 % éch. 29/09/2023 (e)(g)		200		198	0,00
6,250 % éch. 23/03/2023 (e)(g)	$	200		183	0,00
Intesa Sanpaolo SpA					
2,125 % éch. 30/08/2023	€	11 400		11 364	0,22
6,250 % éch. 16/05/2024 (e)(g)		200		193	0,00
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau					
0,000 % éch. 15/09/2023 (c)		2 500		2 456	0,05
0,500 % éch. 15/09/2027		10 000		8 897	0,17
LeasePlan Corp. NV					
0,125 % éch. 13/09/2023		2 800		2 732	0,05
1,000 % éch. 02/05/2023		5 100		5 066	0,10
Lloyds Banking Group PLC					
1,000 % éch. 09/11/2023		1 000		985	0,02
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.					
2,504 % éch. 30/05/2023		1 300		1 302	0,03
Mizuho Financial Group, Inc.					
1,020 % éch. 11/10/2023		2 500		2 460	0,05
Nasdaq, Inc.					
3,850 % éch. 30/06/2026	$	100		91	0,00
NatWest Group PLC					
2,000 % éch. 04/03/2025	€	7 000		6 831	0,13
2,500 % éch. 22/03/2023		3 000		3 001	0,06
NatWest Markets PLC					
1,125 % éch. 14/06/2023		1 100		1 093	0,02
Société Générale S.A.					
7,875 % éch. 18/12/2023 (e)(g)	$	1 200		1 116	0,02
Standard Chartered PLC					
7,750 % éch. 02/04/2023 (e)(g)	$	600		559	0,01
Stichting AK Rabobank Certificaten					
6,500 % (e)	€	1 051		1 010	0,02
Sumitomo Mitsui Banking Corp.					
2,750 % éch. 24/07/2023	€	2 500	€	2 502	0,05
				144 522	**2,83**
INDUSTRIE					
Bacardi Ltd.					
2,750 % éch. 03/07/2023		1 000		998	0,02
BMW Finance NV					
0,625 % éch. 06/10/2023		900		886	0,01
Highland Holdings SARL					
0,000 % éch. 12/11/2023 (c)		5 200		5 050	0,10
Medtronic Global Holdings S.C.A.					
0,375 % éch. 07/03/2023		300		299	0,01
Smurfit Kappa Acquisitions ULC					
2,875 % éch. 15/01/2026		500		485	0,01
				7 718	**0,15**
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS					
Contemporary Ruiding Development Ltd.					
1,875 % éch. 17/09/2025	$	4 800		4 058	0,08
EDP - Energias de Portugal S.A.					
2,375 % éch. 27/11/2023	€	300		299	0,01
Eurogrid GmbH					
1,625 % éch. 03/11/2023		3 000		2 971	0,05
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.					
4,465 % éch. 03/11/2023	$	8 250		7 699	0,15
Optus Finance Pty. Ltd.					
1,000 % éch. 20/06/2029	€	700		571	0,01
				15 598	**0,30**
Total des Obligations et billets privés				167 838	3,28
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES					
Luminar Technologies, Inc.					
1,250 % éch. 15/12/2026	$	17 000		9 020	0,18
Sunnova Energy International, Inc.					
2,625 % éch. 15/02/2028		5 400		4 111	0,08
				13 131	**0,26**
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX					
Adjustable Rate Mortgage Trust					
3,623 % éch. 25/04/2035		30		27	0,00
American Home Mortgage Assets Trust					
6,750 % éch. 25/11/2046		61		49	0,00
BCAP LLC Trust					
4,611 % éch. 26/03/2037		332		303	0,01
5,689 % éch. 25/09/2047		173		140	0,00
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust					
3,280 % éch. 25/07/2036 ^		469		371	0,01
Bear Stearns ALT-A Trust					
3,580 % éch. 25/09/2047 ^		5 302		2 611	0,05
6,114 % éch. 25/07/2034		840		770	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust					
3,871 % éch. 25/09/2037 ^		52		42	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust					
3,594 % éch. 25/06/2037 ^		485		389	0,01
4,709 % éch. 25/02/2047		58		47	0,00
4,989 % éch. 25/08/2035		661		549	0,01
4,993 % éch. 20/12/2035		99		81	0,00
6,000 % éch. 25/01/2037		264		144	0,00
6,000 % éch. 25/07/2037		106		53	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust					
4,869 % éch. 25/04/2036 ^		351		275	0,01
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust					
3,726 % éch. 25/11/2037		75		63	0,00
4,969 % éch. 25/04/2035		1 719		1 391	0,03
4,989 % éch. 25/05/2035		152		110	0,00
6,000 % éch. 25/07/2036		68		36	0,00
6,500 % éch. 25/12/2037		97		42	0,00
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust					
4,310 % éch. 25/01/2034 ^		637		480	0,01
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust					
4,529 % éch. 19/10/2036		90		67	0,00
Fingal Securities RMBS DAC					
2,578 % éch. 28/07/2055	€	73	€	73	0,00
Formentera Issuer PLC					
3,844 % éch. 28/07/2047	£	3 441		3 823	0,07
FWD Securitization Trust					
2,240 % éch. 25/01/2050	$	133		111	0,00
Greenpoint Mortgage Funding Trust					
4,629 % éch. 25/10/2045		987		890	0,02
GSMPS Mortgage Loan Trust					
4,739 % éch. 25/03/2035		2 064		1 825	0,03
HarborView Mortgage Loan Trust					
4,048 % éch. 19/10/2035		82		44	0,00
4,749 % éch. 19/12/2036		533		412	0,01
Harbour Energy PLC					
3,844 % éch. 28/01/2054	£	1 579		1 752	0,03
Impac CMB Trust					
5,029 % éch. 25/03/2035	$	51		43	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust					
3,274 % éch. 25/06/2036		1 815		1 394	0,03
3,333 % éch. 25/08/2037		2 847		1 809	0,03
4,749 % éch. 25/02/2037 ^		79		65	0,00
4,969 % éch. 25/01/2036		522		331	0,01
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust					
4,248 % éch. 05/07/2033		1 000		877	0,02
5,372 % éch. 05/07/2033		968		854	0,02
Kentmere PLC					
3,844 % éch. 28/01/2042	£	1 480		1 592	0,03
Lehman XS Trust					
4,889 % éch. 25/08/2037	$	1 796		1 506	0,03
Miravet SARL					
2,758 % éch. 26/05/2065	€	3 050		2 948	0,06
Mortgage Equity Conversion Asset Trust					
5,140 % éch. 25/05/2042	$	127		104	0,00
New Residential Mortgage Loan Trust					
4,500 % éch. 25/05/2058		425		374	0,01
Polaris PLC					
4,222 % éch. 23/12/2058	£	1 375		1 512	0,03
4,732 % éch. 23/05/2059		10 612		11 820	0,23
Precise Mortgage Funding PLC					
4,587 % éch. 12/12/2055		3 255		3 640	0,07
Residential Accredit Loans, Inc. Trust					
2,644 % éch. 25/10/2037	$	328		268	0,01
6,500 % éch. 25/07/2036		94		69	0,00
Stanlington PLC					
4,337 % éch. 12/06/2045	£	12 321		13 604	0,27
Towd Point Mortgage Funding PLC					
3,826 % éch. 20/07/2045		7 159		7 983	0,16
4,071 % éch. 20/10/2051		2 056		2 303	0,04
4,190 % éch. 20/02/2045		466		518	0,01
4,471 % éch. 20/02/2054		564		633	0,01
Tower Bridge Funding PLC					
3,851 % éch. 21/07/2064		718		802	0,02
4,051 % éch. 20/11/2063		8 169		9 032	0,18
Tudor Rose Mortgages					
4,031 % éch. 20/06/2048		2 245		2 495	0,05
Twin Bridges PLC					
4,386 % éch. 12/09/2050		1 163		1 308	0,02
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
3,096 % éch. 25/08/2046	$	8 416		6 020	0,12
3,290 % éch. 25/02/2037 ^		36		30	0,00
5,189 % éch. 25/06/2044		312		263	0,01
				91 167	**1,78**
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS					
Accredited Mortgage Loan Trust					
5,259 % éch. 25/09/2035		2 800		2 457	0,05
Accunia European CLO DAC					
2,308 % éch. 15/10/2030	€	798		785	0,02
2,328 % éch. 15/07/2030		1 248		1 224	0,02
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust					
4,689 % éch. 25/04/2036	$	256		231	0,00
4,689 % éch. 25/07/2036		237		83	0,00
Adagio CLO DAC					
2,098 % éch. 15/10/2031	€	2 500		2 437	0,05
Aqueduct European CLO DAC					
2,096 % éch. 20/07/2030		3 500		3 431	0,07

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Ares European CLO DAC				
2,038 % éch. 15/10/2030	€	2 991	€ 2 919	0,06
2,158 % éch. 15/10/2031		6 400	6 203	0,12
Armada Euro CLO DAC				
2,098 % éch. 15/07/2031		6 300	6 120	0,12
Aurium CLO DAC				
2,048 % éch. 16/04/2030		598	586	0,01
Avoca CLO DAC				
2,068 % éch. 15/07/2030		1 732	1 696	0,03
2,198 % éch. 15/10/2032		1 900	1 839	0,04
Bain Capital Euro CLO DAC				
2,196 % éch. 20/01/2032		2 900	2 825	0,06
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
5,439 % éch. 25/08/2037	$	168	141	0,00
Black Diamond CLO DAC				
2,316 % éch. 20/01/2032	€	1 929	1 886	0,04
2,778 % éch. 15/05/2032		3 000	2 909	0,06
2,834 % éch. 03/10/2029		23	22	0,00
Blackrock European CLO DAC				
1,998 % éch. 15/10/2031		5 000	4 848	0,10
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				
1,050 % éch. 15/01/2031		400	360	0,01
2,028 % éch. 15/07/2030		1 643	1 605	0,03
2,098 % éch. 15/01/2031		3 099	3 014	0,06
2,288 % éch. 15/01/2033		1 000	963	0,02
BNPP AM Euro CLO DAC				
1,978 % éch. 15/04/2031		300	291	0,01
2,028 % éch. 15/10/2031		247	242	0,00
Cairn CLO DAC				
2,158 % éch. 15/10/2031		3 700	3 622	0,07
2,178 % éch. 30/04/2031		3 651	3 561	0,07
2,275 % éch. 31/01/2030		614	601	0,01
2,333 % éch. 25/07/2029		1 434	1 422	0,03
2,688 % éch. 20/10/2028		97	95	0,00
Carlyle Euro CLO DAC				
2,078 % éch. 15/01/2031		4 998	4 877	0,10
2,428 % éch. 15/08/2030		199	194	0,00
2,688 % éch. 15/08/2032		1 450	1 409	0,03
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				
2,338 % éch. 16/01/2033		1 000	963	0,02
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
2,548 % éch. 15/11/2031		3 650	3 537	0,07
Carrington Mortgage Loan Trust				
4,989 % éch. 25/01/2036	$	10 689	9 519	0,19
CIT Mortgage Loan Trust				
5,889 % éch. 25/10/2037		400	357	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust				
4,336 % éch. 25/10/2037		781	637	0,01
7,250 % éch. 25/05/2036		112	55	0,00
Contego CLO BV				
2,148 % éch. 15/10/2030	€	1 000	977	0,02
Contego CLO DAC				
2,142 % éch. 23/01/2030		2 296	2 238	0,04
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,529 % éch. 25/08/2037	$	1 727	1 587	0,03
4,609 % éch. 25/09/2037 ^		58	56	0,00
4,639 % éch. 25/02/2036		115	97	0,00
CVC Cordatus Loan Fund DAC				
2,028 % éch. 15/10/2031	€	8 700	8 449	0,17
2,112 % éch. 21/07/2030		4 711	4 618	0,09
2,676 % éch. 15/09/2031		2 700	2 628	0,05
Dryden Euro CLO DAC				
2,038 % éch. 15/04/2033		5 000	4 851	0,09
2,622 % éch. 15/05/2034		5 900	5 734	0,11
Ellington Loan Acquisition Trust				
5,489 % éch. 25/05/2037	$	98	89	0,00
Euro-Galaxy CLO DAC				
2,122 % éch. 24/04/2034	€	3 700	3 589	0,07
First Franklin Mortgage Loan Trust				
5,094 % éch. 25/11/2036	$	7 386	6 599	0,13
Fremont Home Loan Trust				
4,529 % éch. 25/01/2037		399	187	0,00
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				
2,356 % éch. 20/01/2032	€	900	870	0,02
Griffith Park CLO DAC				
2,522 % éch. 21/11/2031		16 100	15 586	0,30
Grosvenor Place CLO BV				
2,325 % éch. 30/10/2029	€	219	€ 217	0,00
GSAA Home Equity Trust				
4,489 % éch. 25/12/2046	$	994	478	0,01
5,985 % éch. 25/06/2036		1 159	290	0,01
Harvest CLO DAC				
1,040 % éch. 15/07/2031	€	500	452	0,01
2,018 % éch. 15/10/2031		4 400	4 277	0,08
2,136 % éch. 20/10/2031		7 400	7 187	0,14
2,138 % éch. 15/07/2031		4 000	3 863	0,08
2,228 % éch. 15/01/2032		19 900	19 282	0,38
2,433 % éch. 18/11/2029		77	76	0,00
2,775 % éch. 26/06/2030		3 860	3 775	0,07
Hill FL BV				
2,391 % éch. 18/05/2030		13 700	13 692	0,27
Invesco Euro CLO DAC				
2,028 % éch. 15/07/2031		500	486	0,01
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
4,599 % éch. 25/10/2036	$	103	95	0,00
4,689 % éch. 25/03/2037		13 800	12 114	0,24
Jubilee CLO DAC				
1,978 % éch. 15/04/2030	€	1 400	1 370	0,03
1,988 % éch. 15/04/2030		3 800	3 715	0,07
2,028 % éch. 15/04/2031		4 300	4 160	0,08
2,128 % éch. 12/07/2028		25	25	0,00
2,846 % éch. 15/12/2029		436	428	0,01
Laurelin DAC				
2,176 % éch. 20/10/2031		4 700	4 557	0,09
Madison Park Euro Funding DAC				
2,178 % éch. 15/07/2032		3 200	3 101	0,06
Man GLG Euro CLO DAC				
2,058 % éch. 15/10/2030		2 159	2 109	0,04
2,248 % éch. 15/01/2030		572	559	0,01
2,736 % éch. 15/12/2031		4 400	4 268	0,08
Marlay Park CLO DAC				
2,118 % éch. 15/10/2030		1 000	978	0,02
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
5,169 % éch. 25/02/2034	$	1 263	1 122	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
4,639 % éch. 25/07/2036		134	106	0,00
4,689 % éch. 25/07/2036		263	100	0,00
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				
4,489 % éch. 25/04/2037		104	54	0,00
NovaStar Mortgage Funding Trust				
4,589 % éch. 25/09/2037		138	124	0,00
Oak Hill European Credit Partners DAC				
2,186 % éch. 20/01/2032	€	885	864	0,02
2,196 % éch. 20/10/2031		8 200	7 956	0,16
Oak Hill European Credit Partners Ltd.				
2,356 % éch. 22/07/2030		3 179	3 149	0,06
OCP Euro CLO DAC				
0,000 % éch. 20/01/2033 (a)		20 900	20 795	0,41
2,382 % éch. 22/09/2034		5 200	5 054	0,10
Option One Mortgage Loan Trust				
4,529 % éch. 25/03/2037	$	180	151	0,00
4,609 % éch. 25/04/2037		504	337	0,01
4,609 % éch. 25/05/2037		368	210	0,00
5,169 % éch. 25/11/2034		141	127	0,00
Palmer Square European Loan Funding DAC				
2,098 % éch. 15/10/2031	€	4 107	3 983	0,08
2,108 % éch. 15/07/2031		3 098	3 016	0,06
2,158 % éch. 15/04/2031		1 707	1 660	0,03
Palmerston Park CLO DAC				
2,053 % éch. 18/04/2030		956	939	0,02
PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartment				
2,594 % éch. 26/11/2030		11 517	11 521	0,23
Renaissance Home Equity Loan Trust				
5,285 % éch. 25/01/2037	$	227	69	0,00
5,545 % éch. 25/01/2037		334	107	0,00
Residential Asset Securities Corp. Trust				
5,069 % éch. 25/05/2037		1 363	1 260	0,02
Saxon Asset Securities Trust				
4,679 % éch. 25/09/2036		7 500	6 424	0,13
Segovia European CLO DAC				
2,336 % éch. 20/07/2032	€	4 100	3 970	0,08
Silver Arrow Merfina SRL				
2,448 % éch. 20/07/2033		18 987	18 983	0,37
Silver Arrow S.A.				
2,386 % éch. 15/09/2027	€	367	€ 368	0,01
Sound Point Euro CLO Funding DAC				
2,978 % éch. 15/01/2032		12 500	12 393	0,24
Soundview Home Loan Trust				
4,539 % éch. 25/03/2037	$	63	55	0,00
4,559 % éch. 25/07/2037		786	621	0,01
4,559 % éch. 25/08/2037		881	710	0,01
4,889 % éch. 25/10/2036		167	148	0,00
5,289 % éch. 25/10/2037		1 980	1 448	0,03
Tikehau CLO DAC				
2,596 % éch. 04/08/2034	€	2 300	2 233	0,04
Toro European CLO DAC				
2,239 % éch. 12/01/2032		1 700	1 638	0,03
2,572 % éch. 15/02/2034		5 300	5 112	0,10
			346 482	**6,77**

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement chypriote				
3,750 % éch. 26/07/2023		1 400	1 413	0,03
Obligation internationale du gouvernement français				
0,000 % éch. 25/03/2023 (c)		6 650	6 621	0,13
Obligation internationale du gouvernement japonais				
0,100 % éch. 01/03/2023	¥	3 091 000	21 957	0,43
Stockholms Lans Landsting				
0,750 % éch. 26/02/2025	€	7 000	6 612	0,13
			36 603	**0,72**

	ACTIONS		
ACTIONS ORDINAIRES			
SERVICES DE COMMUNICATION			
Activision Blizzard, Inc.	123 900	8 887	0,18
Nexon Co. Ltd.	741 100	15 506	0,30
Nintendo Co. Ltd.	226 500	8 876	0,17
		33 269	**0,65**
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE			
Aptiv PLC (b)	214 100	18 683	0,36
BYD Co. Ltd. « H »	1 308 554	30 083	0,59
Luminar Technologies, Inc. (b)	2 505 000	11 618	0,23
Panasonic Holdings Corp.	4 421 740	34 489	0,67
QuantumScape Corp. (b)	196 400	1 043	0,02
Shimano, Inc.	65 300	9 617	0,19
Xpeng, Inc. (b)	1 813 100	16 887	0,33
		122 420	**2,39**
ÉNERGIE			
Exxon Mobil Corp.	263 000	27 181	0,53
Neste Oyj	109 200	4 705	0,09
SK Innovation Co. Ltd. (b)	128 100	14 663	0,29
		46 549	**0,91**
SOINS DE SANTÉ			
Chugai Pharmaceutical Co. Ltd.	305 500	7 262	0,14
Elevance Health, Inc.	85 930	41 302	0,81
Exact Sciences Corp. (b)	137 700	6 388	0,13
Exelixis, Inc. (b)	1 135 300	17 063	0,33
Halozyme Therapeutics, Inc. (b)	531 800	28 353	0,55
Hologic, Inc. (b)	331 200	23 216	0,45
Humana, Inc.	92 270	44 282	0,87
Incyte Corp. (b)	456 300	34 340	0,67
Kyowa Kirin Co. Ltd.	379 900	8 109	0,16
Merck & Co., Inc.	77 500	8 057	0,16
Moderna, Inc. (b)	35 250	5 933	0,12
Molina Healthcare, Inc. (b)	34 300	10 613	0,21
Neurocrine Biosciences, Inc. (b)	111 900	12 523	0,24
Pfizer, Inc. (b)	278 500	13 371	0,26

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

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. (b)	60 700	€ 41 035	0,80
Seagen, Inc. (b)	85 200	10 259	0,20
Shionogi & Co. Ltd.	335 250	15 589	0,31
United Therapeutics Corp. (b)	94 600	24 649	0,48
Vertex Pharmaceuticals, Inc. (b)	192 000	51 952	1,02
		404 296	**7,91**
INDUSTRIE			
ABB Ltd.	579 300	16 533	0,32
Aker Carbon Capture ASA (b)	9 186 261	10 046	0,20
Ballard Power Systems, Inc. (b)	527 600	2 364	0,05
Contemporary Amperex Technology Co. Ltd. « A »	119 700	6 320	0,12
Daifuku Co. Ltd.	207 900	9 032	0,18
FuelCell Energy, Inc. (b)	3 395 200	8 844	0,17
Generac Holdings, Inc. (b)	143 900	13 572	0,26
GXO Logistics, Inc. (b)	373 500	14 940	0,29
Hitachi Zosen Corp.	3 432 700	19 991	0,39
ITM Power PLC (b)	4 480 333	4 641	0,09
Mitsubishi Electric Corp.	2 025 370	18 704	0,36
NEL ASA (b)	11 600 925	15 310	0,30
Plug Power, Inc. (b)	1 350 700	15 655	0,31
PowerCell Sweden AB (b)	384 763	4 137	0,08
Schneider Electric SE	189 600	24 874	0,49
Secom Co. Ltd.	141 960	7 549	0,15
Sensata Technologies Holding PLC	456 276	17 264	0,34
Siemens Energy AG (b)	852 300	14 950	0,29
SMC Corp.	19 900	7 744	0,15
Taisei Corp.	231 200	6 948	0,14
Titan Wind Energy Suzhou Co. Ltd. « A »	3 180 147	6 461	0,13
Valmet Oyj	896 500	22 608	0,44
Vestas Wind Systems A/S	1 579 000	43 028	0,84
Xinjiang Goldwind Science & Technology Co. Ltd. « H »	16 245 200	13 494	0,26
		325 009	**6,35**
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION			
Advantest Corp.	323 200	19 292	0,38
Ambarella, Inc. (b)	308 000	23 731	0,46
ams-OSRAM AG (b)	1 449 800	9 947	0,19
ANSYS, Inc. (b)	26 400	5 976	0,12
Applied Materials, Inc.	291 300	26 579	0,52
Arista Networks, Inc. (b)	85 100	9 676	0,19
BE Semiconductor Industries NV	88 100	5 016	0,10
Canadian Solar, Inc. (b)	245 900	7 119	0,14
Chipbond Technology Corp.	5 933 908	10 366	0,20
Cirrus Logic, Inc. (b)	240 100	16 756	0,33
Cognex Corp.	112 723	4 976	0,10
Daqo New Energy Corp. (b)	311 100	11 255	0,22
Delta Electronics, Inc.	1 865 112	16 200	0,32
Disco Corp.	38 200	10 147	0,20
Elan Microelectronics Corp.	2 834 109	7 403	0,14
Enphase Energy, Inc. (b)	113 700	28 228	0,55
First Solar, Inc. (b)	342 400	48 056	0,95
Flex Ltd. (b)	835 700	16 804	0,33
Globalwafers Co. Ltd.	950 309	12 338	0,24
GoerTek, Inc. « A »	4 187 905	9 485	0,19
Hamamatsu Photonics KK	275 800	12 268	0,24
Ibiden Co. Ltd.	426 700	14 341	0,28
Infineon Technologies AG	519 200	€ 14 741	0,29
Intel Corp.	254 800	6 310	0,12
Lam Research Corp.	71 670	28 225	0,55
LONGi Green Energy Technology Co. Ltd. « A »	3 727 597	21 150	0,41
Marvell Technology, Inc.	388 800	13 494	0,26
MediaTek, Inc.	501 008	9 492	0,19
Micron Technology, Inc.	431 200	20 193	0,39
Nanya Technology Corp.	7 234 907	11 258	0,22
NetApp, Inc.	529 300	29 787	0,58
Novatek Microelectronics Corp.	1 433 204	13 728	0,27
NXP Semiconductors NV	118 400	17 532	0,34
Otsuka Corp.	238 400	7 003	0,14
Power Integrations, Inc.	168 200	11 303	0,22
Realtek Semiconductor Corp.	1 102 407	9 394	0,18
Samsung Electronics Co. Ltd.	926 700	38 113	0,75
Samsung SDI Co. Ltd.	28 771	12 658	0,25
Shimadzu Corp. (b)	290 800	7 673	0,15
SMA Solar Technology AG	198 723	13 287	0,26
SolarEdge Technologies, Inc. (b)	172 400	45 758	0,89
Synopsys, Inc. (b)	40 400	12 086	0,24
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	3 499 809	47 626	0,93
Teradyne, Inc.	256 700	21 010	0,41
Texas Instruments, Inc.	33 200	5 140	0,10
Tokyo Electron Ltd.	82 670	22 639	0,44
Trend Micro, Inc.	90 500	3 945	0,08
Trimble, Inc. (b)	163 000	7 722	0,15
Unimicron Technology Corp.	2 665 100	9 694	0,19
United Microelectronics Corp.	19 904 819	24 505	0,48
Velodyne Lidar, Inc. (b)	1 683 500	1 165	0,02
Xinyi Solar Holdings Ltd.	5 738 500	5 917	0,12
Zebra Technologies Corp. « A » (b)	82 200	19 749	0,39
		838 256	**16,40**
MATÉRIAUX			
Calix Ltd. (b)	1 188 128	3 355	0,07
Canfor Corp. (b)	1 004 500	14 803	0,29
CF Industries Holdings, Inc.	78 500	6 267	0,12
Hanwha Solutions Corp. (b)	605 600	19 403	0,38
Holmen AB « B »	512 100	19 099	0,37
LG Chem Ltd.	74 200	33 200	0,65
Mosaic Co.	102 600	4 217	0,08
Nitto Denko Corp.	332 800	17 864	0,35
Nutrien Ltd.	60 800	4 160	0,08
Shin-Etsu Chemical Co. Ltd.	222 460	25 317	0,49
Stora Enso Oyj « R »	1 311 100	17 269	0,34
thyssenkrupp AG (b)	1 531 800	8 690	0,17
UPM-Kymmene Oyj	958 400	33 504	0,66
West Fraser Timber Co. Ltd.	276 700	18 708	0,37
		225 856	**4,42**
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS			
Xinyi Energy Holdings Ltd.	26 358 479	8 166	0,16
		2 003 821	**39,19**
DROITS			
Hanwha Solutions Corp. - Exp. 09/01/2023	5 188	€ 19	0,00
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT IMMOBILIER			
Weyerhaeuser Co.	462 700	13 440	0,26

	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BILLETS DE TRÉSORERIE			
Acciona Energia Financiacion Filiales S.A. 2,078 % éch. 16/01/2023	€ 18 500	18 482	0,36
Agence France-Presse Ltd. 1,622 % éch. 13/01/2023	2 000	1 998	0,04
Amcor UK Finance PLC 1,937 % éch. 01/02/2023	15 000	14 970	0,29
Fidelity National Information Services, Inc. 1,774 % éch. 09/01/2023	12 500	12 493	0,25
1,896 % éch. 30/01/2023	16 000	15 971	0,31
Fiserv, Inc. 1,673 % éch. 05/01/2023	6 200	6 198	0,12
National Grid PLC 1,825 % éch. 09/01/2023	15 000	14 992	0,30
1,825 % éch. 12/01/2023	15 000	14 989	0,29
Nomura Bank International PLC 2,078 % éch. 28/02/2023	17 800	17 735	0,35
SGS Nederland Holding BV 2,099 % éch. 30/01/2023	26 800	26 753	0,52
2,109 % éch. 12/01/2023	17 500	17 487	0,34
2,210 % éch. 19/01/2023	12 800	12 786	0,25
Universal Music Group NV 2,099 % éch. 13/02/2023	16 000	15 962	0,31
		190 816	**3,73**
BONS DU TRÉSOR BELGE			
1,641 % éch. 09/03/2023 (c)(d)	8 150	8 124	0,16
1,642 % éch. 09/03/2023 (c)(d)	8 150	8 124	0,16
		16 248	**0,32**
BONS DU TRÉSOR DU MÉCANISME EUROPÉEN DE STABILISATION			
0,253 % éch. 19/01/2023 (c)(d)	30 900	30 879	0,60
0,274 % éch. 19/01/2023 (c)(d)	15 300	15 290	0,30
0,304 % éch. 19/01/2023 (c)(d)	7 900	7 895	0,15
0,578 % éch. 13/04/2023 (c)(d)	17 500	17 395	0,34
0,929 % éch. 05/01/2023 (c)(d)	4 700	4 700	0,09
1,441 % éch. 23/03/2023 (c)(d)	3 000	2 987	0,06
1,541 % éch. 09/02/2023 (c)(d)(h)	15 500	15 472	0,30
1,754 % éch. 09/03/2023 (c)(d)	11 800	11 763	0,23
1,755 % éch. 09/03/2023 (c)(d)	14 750	14 703	0,29
1,760 % éch. 09/03/2023 (c)(d)	14 750	14 703	0,29
1,876 % éch. 20/04/2023 (c)(d)(h)	16 380	16 275	0,32
2,212 % éch. 18/05/2023 (c)(d)	14 195	14 071	0,28
2,231 % éch. 18/05/2023 (c)(d)	25 160	24 941	0,49
		191 074	**3,74**
BONS DU TRÉSOR DE L'UNION EUROPÉENNE			
0,233 % éch. 06/01/2023 (c)(d)	54	54	0,00
0,967 % éch. 03/03/2023 (c)(d)	14 900	14 856	0,29
1,034 % éch. 03/03/2023 (c)(d)	4 230	4 218	0,08
1,369 % éch. 03/03/2023 (c)(d)	5 700	5 683	0,11
1,402 % éch. 03/03/2023 (c)(d)	30 100	30 012	0,59
1,407 % éch. 03/03/2023 (c)(d)	30 100	30 012	0,59
1,587 % éch. 07/04/2023 (c)(d)	11 100	11 041	0,21
1,632 % éch. 03/03/2023 (c)(d)	13 750	13 710	0,27
1,640 % éch. 03/03/2023 (c)(d)	10 100	10 070	0,20
1,649 % éch. 03/03/2023 (c)(d)	13 750	13 710	0,27
1,764 % éch. 03/03/2023 (c)(d)	12 600	12 563	0,24
1,866 % éch. 07/04/2023 (c)(d)	8 200	8 157	0,16
1,876 % éch. 07/04/2023 (c)(d)	31 000	30 836	0,60
		184 922	**3,61**
BONS DU TRÉSOR FRANÇAIS			
0,740 % éch. 08/02/2023 (c)(d)	22 200	22 170	0,43
0,904 % éch. 08/02/2023 (c)(d)	5 700	5 692	0,11

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
0,918 % éch. 08/02/2023 (c)(d)	€	4 600	€ 4 594	0,09
0,994 % éch. 22/02/2023 (c)(d)		14 600	14 570	0,28
1,402 % éch. 08/03/2023 (c)(d)		5 500	5 484	0,11
1,435 % éch. 15/02/2023 (c)(d)		12 240	12 219	0,24
1,462 % éch. 15/02/2023 (c)(d)		100	100	0,00
1,467 % éch. 15/02/2023 (c)(d)		400	399	0,01
1,484 % éch. 15/02/2023 (c)(d)		200	200	0,00
1,501 % éch. 15/02/2023 (c)(d)		200	200	0,00
1,511 % éch. 01/03/2023 (c)(d)		2 300	2 294	0,05
1,527 % éch. 01/03/2023 (c)(d)		2 400	2 394	0,05
1,600 % éch. 22/03/2023 (c)(d)		4 700	4 683	0,09
1,607 % éch. 05/04/2023 (c)(d)		12 000	11 946	0,23
1,612 % éch. 22/03/2023 (c)(d)		4 550	4 534	0,09
1,622 % éch. 08/03/2023 (c)(d)		33 100	33 006	0,65
1,625 % éch. 22/03/2023 (c)(d)		4 700	4 683	0,09
1,715 % éch. 05/04/2023 (c)(d)		3 075	3 061	0,06
1,719 % éch. 15/03/2023 (c)(d)		1 000	997	0,02
1,723 % éch. 05/04/2023 (c)(d)		3 075	3 061	0,06
1,724 % éch. 15/03/2023 (c)(d)		700	698	0,01
1,724 % éch. 05/04/2023 (c)(d)		7 200	7 168	0,14
1,727 % éch. 05/04/2023 (c)(d)		4 800	4 778	0,09
1,734 % éch. 15/03/2023 (c)(d)		1 400	1 395	0,03
1,749 % éch. 15/03/2023 (c)(d)		5 500	5 482	0,11
1,765 % éch. 15/03/2023 (c)(d)		15 900	15 846	0,31
2,005 % éch. 04/05/2023 (c)(d)		5 450	5 414	0,11
			177 068	**3,46**
BONS DU TRÉSOR ALLEMAND				
0,812 % éch. 22/03/2023 (c)(d)		4 250	4 235	0,08
1,257 % éch. 22/02/2023 (c)(d)		18 460	18 423	0,36
			22 658	**0,44**
BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN				
0,011 % éch. 04/01/2023 (c)(d)	ILS	8 600	2 283	0,04
0,022 % éch. 04/01/2023 (c)(d)		27 300	7 246	0,14
0,746 % éch. 05/04/2023 (c)(d)		19 300	5 077	0,10
0,753 % éch. 05/04/2023 (c)(d)		12 600	3 314	0,07
0,886 % éch. 03/05/2023 (c)(d)		27 300	7 165	0,14
			25 085	**0,49**

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
BONS DU TRÉSOR ITALIEN				
1,078 % éch. 31/03/2023 (c)(d)	€	27 000	€ 26 866	0,53
1,815 % éch. 31/03/2023 (c)(d)		29 400	29 254	0,57
2,179 % éch. 28/04/2023 (c)(d)		13 000	12 913	0,25
2,197 % éch. 28/04/2023 (c)(d)		20 300	20 163	0,39
2,200 % éch. 28/04/2023 (c)(d)		49 300	48 968	0,96
			138 164	**2,70**
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS				
(0,249) % éch. 11/01/2023 (c)(d)	¥	93 000	660	0,01
(0,242) % éch. 23/01/2023 (c)(d)		724 000	5 142	0,10
(0,209) % éch. 06/01/2023 (c)(d)		9 977 000	70 851	1,38
(0,191) % éch. 06/01/2023 (c)(d)		3 713 000	26 368	0,52
(0,182) % éch. 20/03/2023 (c)(d)		12 787 000	90 838	1,78
(0,181) % éch. 13/03/2023 (c)(d)		11 094 000	78 809	1,54
(0,171) % éch. 20/03/2023 (c)(d)		2 623 000	18 634	0,36
(0,166) % éch. 13/03/2023 (c)(d)		4 386 000	31 157	0,61
(0,142) % éch. 06/03/2023 (c)(d)		12 973 000	92 153	1,80
(0,131) % éch. 06/03/2023 (c)(d)		12 359 000	87 792	1,72
			502 404	**9,82**
BONS DU TRÉSOR ESPAGNOL				
1,565 % éch. 10/02/2023 (c)(d)	€	10 000	9 984	0,20
Total des Instruments à court terme			1 458 423	28,51
Total des Valeurs mobilières			**€ 4 130 924**	**80,77**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Income Fund (f)	6 473 317	€ 101 171	1,98
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Capital Securities Fund (f)	2 900 175	29 511	0,58
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (f)	2 716 001	28 452	0,55
		159 134	**3,11**
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)	3 415 400	330 007	6,45
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF (f)	1 532 400	15 273	0,30
		345 280	**6,75**
Total des Fonds d'investissement		**€ 504 414**	**9,86**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BPS	(1,000) %	30/12/2022	02/01/2023	€ 5 000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,625 % échéance 07/01/2028	€ (161)	€ 5 000	€ 5 000	0,10
					Landwirtschaftliche Rentenbank 0,500 % échéance 28/02/2029	(4 907)			
	1,850	19/12/2022	09/01/2023	17 818	Bons du Trésor du Mécanisme européen de stabilisation 0,000 % échéance 16/03/2023	(18 150)	17 818	17 837	0,35
CDI	1,780	30/12/2022	02/01/2023	100 000	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 4,125 % échéance 25/04/2023	(100 270)	100 000	100 015	1,96
FICC	1,900	30/12/2022	03/01/2023	$ 1 906	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 08/06/2023	(1 822)	1 786	1 786	0,03
Total des Contrats de mise en pension						**€ (125 310)**	**€ 124 604**	**€ 124 638**	**2,44**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars	Long	03/2023	9 367	€ (38 926)	(0,76)
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	95	71	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars	Long	03/2023	2 307	(3 827)	(0,07)
Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini NASDAQ 100 Index mars	Court	03/2023	895	11 145	0,22
Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini Russell 2000 Index mars	Court	03/2023	1 734	4 122	0,08
Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini S&P 500 Index mars	Court	03/2023	2 092	10 442	0,20
Contrats à terme standardisés sur Euro STOXX 50 mars	Court	03/2023	17 128	29 272	0,57
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	Court	03/2023	1 418	11 505	0,23
Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE 100 Index mars	Court	03/2023	3 230	523	0,01
Contrats à terme standardisés sur Nikkei 225 libellé en yen mars	Court	03/2023	2 532	16 902	0,33

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

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	95	€ (455)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	12 716	(2 956)	(0,06)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	8 394	(5 723)	(0,11)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Long	03/2023	2 163	(6 078)	(0,12)
				€ 26 017	0,51

(1) Option de style contrat à terme standardisé.

OPTIONS ACHETÉES

OPTIONS SUR INDICES

Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Nbre de Contrats	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Option d'achat - Indice CBOE NASDAQ 100 Index	€ 12 500,000	20/01/2023	625	€ 7 856	€ 180	0,00

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR INDICES

Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Nbre de Contrats	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
Option de vente - Indice CBOE NASDAQ 100 Index	€ 10 225,000	20/01/2023	190	€ (5 024)	€ (1 029)	(0,02)
Option d'achat - Indice CBOE NASDAQ 100 Index	13 200,000	20/01/2023	625	(2 974)	(59)	0,00
Option de vente - Indice CBOE S&P 500 Index	3 300,000	20/01/2023	429	(3 330)	(73)	0,00
Option de vente - Indice CBOE S&P 500 Index	3 500,000	20/01/2023	415	(1 592)	(216)	(0,01)
Option d'achat - Indice CBOE S&P 500 Index	4 200,000	20/01/2023	661	(3 998)	(67)	0,00
Option d'achat - Indice CBOE S&P 500 Index	4 300,000	20/01/2023	415	(1 140)	(15)	0,00
				€ (18 058)	€ (1 459)	(0,03)

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé	**€ 24 738**	**0,48**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AT&T, Inc.	1,000 %	20/06/2026	$ 500	€ (7)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2027	700	1	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2027	600	4	0,00
				€ (2)	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.HY-35 à 5 ans	5,000 %	20/12/2025	$ 297	€ (14)	0,00
Indice CDX.HY-36 à 5 ans	5,000	20/06/2026	24 354	(1 194)	(0,02)
Indice CDX.HY-37 à 5 ans	5,000	20/12/2026	5 074	(204)	(0,01)
Indice CDX.HY-38 à 5 ans	5,000	20/06/2027	27 918	477	0,01
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000	20/12/2027	149 200	5 256	0,10
Indice CDX.IG-35 à 5 ans	1,000	20/12/2025	4 400	(34)	0,00
Indice CDX.IG-36 à 5 ans	1,000	20/06/2026	15 000	(134)	0,00
Indice CDX.IG-37 à 5 ans	1,000	20/12/2026	3 200	(29)	0,00
Indice CDX.IG-38 à 5 ans	1,000	20/06/2027	395 500	3 258	0,06
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000	20/12/2027	1 070 400	7 001	0,15
Indice iTraxx Crossover 38 à 5 ans	5,000	20/12/2027	€ 16 100	748	0,01
				€ 15 131	0,30

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,000 %	16/06/2026	CAD 585 429	€ (25 044)	(0,50)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,220	03/03/2025	5 692	(299)	(0,01)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,235	04/03/2025	10 835	(578)	(0,01)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,250	16/06/2031	82 272	(6 533)	(0,13)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,275	03/03/2025	5 150	(266)	(0,01)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,276	03/03/2025	3 072	(159)	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,290	03/03/2025	1 536	(79)	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2025	102 600	(5 351)	(0,10)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel		Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2030	CAD	150 600	€ (17 902)	(0,35)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,900	18/12/2029		181	(21)	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,250	15/06/2027		477 100	(4 376)	(0,08)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,500	19/06/2029		123 500	(13 139)	(0,26)
						€ (73 747)	(1,45)
Total des Instruments financiers dérivés compensés						**€ (58 618)**	**(1,15)**

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

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

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

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

OPTIONS ACHETÉES

OPTIONS DE CHANGE

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Option d'achat - EUR contre USD hors cote	$ 1,070	07/02/2023	645 700	€ 6 463	€ 6 934	0,14

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente - Indice iTraxx Europe 37 à 5 ans hors cote	Vente	3,000 %	15/03/2023	9 900	€ (17)	€ (2)	0,00

OPTIONS DE CHANGE

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Option de vente - EUR contre USD hors cote	$ 1,030	07/02/2023	241 000	€ (1 649)	€ (432)	(0,01)
	Option d'achat - EUR contre USD hors cote	1,100	07/02/2023	645 700	(1 963)	(1 474)	(0,03)
					€ (3 612)	€ (1 906)	(0,04)

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,150 %	09/01/2023	142 900	€ (479)	€ (2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	09/01/2023	142 900	(480)	(806)	(0,02)
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547	07/03/2023	17 200	(360)	(36)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	17 200	(360)	(1 015)	(0,02)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	22 700	(252)	(54)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	22 700	(296)	(696)	(0,01)
							€ (2 227)	€ (2 609)	(0,05)

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

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

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel(2)	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Obligation internationale du gouvernement chinois	(1,000) %	20/12/2023	$ 17 130	€ (303)	€ 188	€ (115)	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement chinois	(1,000)	20/12/2023	16 800	(309)	197	(112)	0,00
					€ (612)	€ 385	€ (227)	0,00

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

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

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

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

Contrepartie	À payer/à recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel	Date d'échéance	Primes payées/ (reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	À payer	Indice Industrial Select Sector Index	35 821	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	$ 126 422	21/06/2023	€ 0	€ 440	€ 440	0,01
JPM	À payer	Indice JPPMGSHP Index	750 458	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	60 667	07/06/2023	0	146	146	0,00
MEI	À payer	Indice SX4T Index	43 167	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	€ 127 694	11/01/2023	0	80	80	0,00
							€ 0	€ 666	€ 666	0,01

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€	9 272	NOK	95 957	€ 0	€ (147)	€ (147)	0,00
	01/2023		190 531	$	187 575	0	(14 919)	(14 919)	(0,29)
	01/2023	PEN	31 718		8 350	17	0	17	0,00
	01/2023	$	351 492	€	351 230	22 179	0	22 179	0,43
	01/2023		20 050	HUF	9 073 440	1 897	0	1 897	0,04
	02/2023	PEN	400 000	$	102 743	0	(834)	(834)	(0,02)
	05/2023		26 573		6 773	0	(57)	(57)	0,00
BPS	01/2023	BRL	825		152	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	CHF	2 321	€	2 359	9	0	9	0,00
	01/2023	ILS	938 717	$	273 850	3 591	0	3 591	0,07
	01/2023	¥	42 113 501	€	294 622	0	(4 538)	(4 538)	(0,09)
	01/2023	$	110 404		103 467	64	0	64	0,00
	03/2023		139 794	COP	684 131 253	0	(290)	(290)	(0,01)
	03/2023		64 142	INR	5 321 038	0	(87)	(87)	0,00
	03/2023		37 976	PEN	147 652	228	0	228	0,00
	03/2023		296	TWD	8 918	0	(2)	(2)	0,00
BRC	01/2023	CLP	157 830 036	$	183 308	0	(845)	(845)	(0,02)
	01/2023	€	62 156	£	53 702	0	(1 644)	(1 644)	(0,03)
	01/2023	£	4 734	€	5 381	47	0	47	0,00
	01/2023	¥	1 611 700		11 332	0	(117)	(117)	0,00
	01/2023	$	60 638		57 205	412	0	412	0,01
	03/2023	¥	40 742 000		284 040	0	(6 536)	(6 536)	(0,13)
	03/2023	$	181 610	CLP	157 830 036	896	0	896	0,02
CBK	01/2023	AUD	32 142	€	20 183	0	(237)	(237)	0,00
	01/2023	€	10 028	AUD	15 555	0	(146)	(146)	0,00
	01/2023		64 680	CAD	90 956	0	(1 806)	(1 806)	(0,03)
	01/2023		2 802	¥	394 100	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023		34 654	$	36 590	0	(385)	(385)	(0,01)
	01/2023	£	13 340	€	15 479	448	0	448	0,01
	01/2023	ILS	71 787	$	22 733	1 119	0	1 119	0,02
	01/2023	$	165 640	CLP	157 830 036	9 118	0	9 118	0,18
	01/2023		33	KRW	43 883	1	0	1	0,00
	01/2023		192 058	PEN	770 016	4 411	0	4 411	0,09
	02/2023		115 787	CLP	104 000 000	2 678	0	2 678	0,05
	03/2023	TWD	298 728	$	9 905	53	0	53	0,00
	04/2023	ILS	38 353		11 653	338	0	338	0,01
	04/2023	PEN	207 028		51 664	0	(1 007)	(1 007)	(0,02)
	05/2023	ILS	54 141		16 408	443	0	443	0,01
	05/2023	PEN	63 718		16 099	0	(206)	(206)	0,00
DUB	01/2023	$	137 832	HUF	62 323 333	12 975	0	12 975	0,25
	01/2023		316	TRY	6 462	13	0	13	0,00
GLM	01/2023	BRL	159 438	$	29 573	0	(288)	(288)	(0,01)
	01/2023	HKD	332 211		42 670	42	0	42	0,00
	01/2023	$	22	CNH	152	0	0	0	0,00
	03/2023	CLP	65 400 211	$	71 789	0	(1 987)	(1 987)	(0,04)
	03/2023	COP	552 947 156		114 668	1 018	0	1 018	0,02
	03/2023	MXN	3 576 032		173 954	0	(3 236)	(3 236)	(0,06)
	03/2023	$	114 566	COP	552 947 156	0	(988)	(988)	(0,02)
	03/2023		106 396	MXN	2 111 676	198	0	198	0,00
	05/2023		762	PEN	3 032	11	0	11	0,00
JPM	01/2023	BRL	1 318 507	$	252 781	1 464	0	1 464	0,03
	01/2023	€	2 585	CAD	3 671	0	(47)	(47)	0,00
	01/2023		1 198	£	1 030	0	(37)	(37)	0,00
	01/2023		3 283	¥	461 700	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023		21 266	$	22 308	0	(372)	(372)	(0,01)
	01/2023	£	38 061	€	43 978	1 091	0	1 091	0,02
	01/2023	ILS	153 419	$	44 939	672	0	672	0,01
	01/2023	¥	4 798 931	€	33 571	0	(519)	(519)	(0,01)
	01/2023	NOK	11 545		1 111	13	0	13	0,00
	01/2023	$	281 317	BRL	1 478 770	0	(616)	(616)	(0,01)
	01/2023		190	CNY	1 320	1	0	1	0,00
	01/2023		39 721	€	37 640	438	0	438	0,01
	01/2023		102 057	HUF	45 155 148	8 374	0	8 374	0,16
	01/2023		101 622	PEN	407 727	2 367	0	2 367	0,05
	02/2023		8 682	TWD	263 584	0	(33)	(33)	0,00
	03/2023		341	CNY	2 356	1	0	1	0,00
	04/2023	ILS	25 036	$	7 521	180	0	180	0,00
	04/2023	$	248 325	BRL	1 318 507	0	(1 372)	(1 372)	(0,03)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
MBC	01/2023	AUD	35 783	€	22 752	€ 84	€ (65)	€ 19	0,00
	01/2023	CAD	37 802		26 134	4	(1)	3	0,00
	01/2023	€	1 938	AUD	3 041	0	(6)	(6)	0,00
	01/2023		3 043	CAD	4 390	0	(8)	(8)	0,00
	01/2023		9 620	¥	1 349 700	35	(67)	(32)	0,00
	01/2023		105 102	NOK	1 087 930	0	(1 643)	(1 643)	(0,03)
	01/2023	HKD	1 378 854	$	177 114	181	0	181	0,00
	01/2023	$	1 656 864	€	1 580 897	29 100	0	29 100	0,56
	01/2023		159 087	PLN	808 002	11 694	0	11 694	0,23
	03/2023	¥	15 480 000	€	109 484	0	(935)	(935)	(0,02)
	03/2023	$	346	COP	1 578 154	0	(12)	(12)	0,00
	03/2023		152	INR	12 623	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	€	5 149	AUD	7 994	0	(71)	(71)	0,00
	01/2023		1 138	£	986	0	(27)	(27)	0,00
	01/2023		22 546	SEK	245 724	0	(451)	(451)	(0,01)
	01/2023		7 254	$	7 552	0	(184)	(184)	0,00
	01/2023	£	281	€	318	1	0	1	0,00
	01/2023	ILS	2 833		752	0	0	0	0,00
	01/2023	NOK	7 970		774	16	0	16	0,00
	01/2023	SEK	4 435		405	6	0	6	0,00
	01/2023	$	8 741		8 800	618	0	618	0,01
	02/2023		15 984	TWD	487 312	0	(30)	(30)	0,00
RBC	01/2023	€	2 705	¥	385 400	33	0	33	0,00
	01/2023	¥	13 690 000	€	95 794	0	(1 429)	(1 429)	(0,03)
	03/2023	$	378	MXN	7 554	2	0	2	0,00
	04/2023	MXN	1 782 802	$	86 006	0	(1 714)	(1 714)	(0,03)
RYL	01/2023	€	1 996	¥	288 400	53	0	53	0,00
	01/2023		186 000	$	189 846	0	(8 275)	(8 275)	(0,16)
	01/2023	¥	724 000	€	5 071	0	(77)	(77)	0,00
SCX	01/2023	CHF	47 457		48 283	210	0	210	0,00
	01/2023	DKK	345 620		46 489	10	0	10	0,00
	01/2023	€	8 800	$	8 741	0	(618)	(618)	(0,01)
	01/2023	£	37 636	€	43 556	1 148	0	1 148	0,02
	01/2023	KRW	295 406 591	$	223 554	0	(5 258)	(5 258)	(0,10)
	01/2023	SGD	40	€	28	0	0	0	0,00
	02/2023	TWD	24 493 966	$	796 060	0	(2 214)	(2 214)	(0,04)
	02/2023	$	25 645	CLP	23 000 000	574	0	574	0,01
	03/2023		201 975	INR	16 757 881	0	(259)	(259)	(0,01)
SOG	01/2023	£	136 371	€	157 794	4 131	0	4 131	0,08
	01/2023	HKD	2 240	$	288	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	€	1 752	£	1 515	0	(45)	(45)	0,00
	01/2023	$	506	TRY	10 361	20	0	20	0,00
	03/2023	COP	132 762 251	$	27 551	253	0	253	0,01
	03/2023	¥	3 092 546	€	21 714	0	(326)	(326)	(0,01)
	03/2023	$	27 539	COP	132 762 251	0	(252)	(252)	0,00
						€ 124 980	€ (67 273)	€ 57 707	1,12

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories BM Détail en AUD (couverte) de distribution II et M Détail en AUD (couverte) de distribution II :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	€	6	AUD	9	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
JPM	01/2023		71		109	0	(1)	(1)	0,00
MBC	01/2023		4		6	0	0	0	0,00
RYL	01/2023		71		109	0	(2)	(2)	0,00
SCX	01/2023		71		109	0	(1)	(1)	0,00
						€ 0	€ (4)	€ (4)	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BPS	01/2023	€	1 042	CHF	1 025	€ 0	€ (4)	€ (4)	0,00
JPM	01/2023		1 117		1 098	0	(5)	(5)	0,00
MYI	01/2023	CHF	134	€	137	1	0	1	0,00
	01/2023	€	136	CHF	134	0	0	0	0,00
RBC	01/2023	CHF	44	€	45	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	€	1 067	CHF	1 049	0	(5)	(5)	0,00
						€ 1	€ (14)	€ (13)	0,00

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

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€	138 899	£	119 411	€ 0	€ (4 347)	€ (4 347)	(0,09)
CLY	01/2023		439		382	0	(8)	(8)	0,00
DUB	01/2023		270		238	0	(2)	(2)	0,00
JPM	01/2023		151 441		131 065	0	(3 757)	(3 757)	(0,07)
MBC	01/2023	£	9 305	€	10 527	42	0	42	0,00
RBC	01/2023	€	248	£	220	0	0	0	0,00
	01/2023	£	329	€	381	11	0	11	0,00
RYL	01/2023	€	4 929	£	4 244	0	(147)	(147)	0,00
	01/2023	£	17 993	€	20 862	587	0	587	0,01
SCX	01/2023	€	214 390	£	185 254	0	(5 645)	(5 645)	(0,11)
	01/2023	£	6 094	€	6 880	14	0	14	0,00
SOG	01/2023	€	212 555	£	183 691	0	(5 572)	(5 572)	(0,11)
UAG	01/2023		703		611	0	(15)	(15)	0,00
						€ 654	€ (19 493)	€ (18 839)	(0,37)

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en ILS (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BRC	01/2023	€	77	ILS	275	€ 0	€ (4)	€ (4)	0,00
CBK	01/2023		86		312	0	(3)	(3)	0,00
GLM	01/2023		77		282	0	(2)	(2)	0,00
MYI	01/2023		115		414	0	(5)	(5)	0,00
SCX	01/2023		5		20	0	0	0	0,00
SOG	01/2023		77		275	0	(4)	(4)	0,00
						€ 0	€ (18)	€ (18)	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de capitalisation et M Détail en SGD (couverte) de distribution II :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€	29 043	SGD	41 491	€ 0	€ (63)	€ (63)	0,00
CBK	01/2023		29 043		41 491	0	(63)	(63)	0,00
JPM	01/2023	SGD	1 223	€	848	0	(6)	(6)	0,00
RBC	01/2023	€	1 314	SGD	1 872	0	(6)	(6)	0,00
RYL	01/2023		29 663		42 377	0	(63)	(63)	0,00
	01/2023	SGD	204	€	143	0	0	0	0,00
SOG	01/2023		41		29	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	€	121	SGD	174	0	0	0	0,00
						€ 0	€ (201)	€ (201)	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en USD (couverte) de capitalisation, Institutions en USD (couverte) de distribution II, Investisseurs en USD (couverte) de capitalisation, BM Détail en USD (couverte) de distribution II, E en USD (couverte) de capitalisation, E en USD (couverte) de distribution, E en USD (couverte) de distribution II, H Institutions en USD (couverte) de capitalisation, M Détail en USD (couverte) de distribution II et T en USD (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$	2 088	€	2 005	€ 50	€ 0	€ 50	0,00
BOA	01/2023	€	25 196	$	26 604	0	(280)	(280)	(0,01)
BRC	01/2023	$	698	€	657	3	0	3	0,00
CBK	01/2023	€	129 647	$	134 411	0	(3 759)	(3 759)	(0,07)
	01/2023	$	8 850	€	8 360	71	0	71	0,00
JPM	01/2023	€	27 622	$	28 723	0	(720)	(720)	(0,01)
MBC	01/2023		129 486		135 710	0	(2 381)	(2 381)	(0,05)
	01/2023	$	1 332	€	1 248	1	0	1	0,00
RBC	01/2023	€	980	$	1 032	0	(14)	(14)	0,00
	01/2023	$	577	€	542	2	0	2	0,00
RYL	01/2023	€	96	$	103	0	0	0	0,00
	01/2023	$	9 896	€	9 445	176	0	176	0,00
SCX	01/2023	€	129 617	$	134 912	0	(3 260)	(3 260)	(0,06)
	01/2023	$	1 918	€	1 804	7	0	7	0,00
UAG	01/2023		7 262		6 825	24	0	24	0,00
						€ 334	€ (10 414)	€ (10 080)	(0,20)

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**€ 31 408**	**0,61**
Total des Investissements	**€ 4 757 470**	**93,01**
Autres actifs et passifs à court terme	**€ 357 700**	**6,99**
Actif net	**€ 5 115 170**	**100,00**

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

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

^ **Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.**

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

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

(f) Affilié au Fonds.

(g) Titre convertible conditionnel.

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 17 831 € (31 décembre 2021 : 0 €) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 68 086 € (31 décembre 2021 : 0 €) a été nanti en garantie de ventes à découvert d'actions et d'options sur actions ainsi que le prescrivent les contrats de courtage de premier ordre et les contrats régissant les opérations d'options cotées au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 287 910 € (31 décembre 2021 : 102 757 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 38 420 € (31 décembre 2021 : 32 340 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	€ 1 030 499	€ 3 100 425	€ 0	€ 4 130 924
Fonds d'investissement	159 134	345 280	0	504 414
Contrats de mise en pension	0	124 604	0	124 604
Instruments financiers dérivés[3]	40 774	(43 246)	0	(2 472)
Totaux	**€ 1 230 407**	**€ 3 527 063**	**€ 0**	**€ 4 757 470**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	€ 1 782 223	€ 5 070 325	€ 0	€ 6 852 548
Fonds d'investissement	433 439	16 631	0	450 070
Contrats de mise en pension	0	202 276	0	202 276
Instruments financiers dérivés[3]	(14 811)	15 834	0	1 023
Totaux	**€ 2 200 851**	**€ 5 305 066**	**€ 0**	**€ 7 505 917**

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

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

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

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	En % de l'actif net
BPS	1,550 %	19/12/2022	09/01/2023	€ (17 818)	€ (17 828)	(0,35)
Total des Contrats de prise en pension					**€ (17 828)**	**(0,35)**

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	€ 50	€ 0	€ 50	€ S/O	€ S/O	€ S/O
BOA	3 446	(3 570)	(124)	1 017	(680)	337
BPS	4 322	(10 200)	(5 878)	(3 252)	12 530	9 278
BRC	(7 900)	5 060	(2 840)	807	7 140	7 947
CBK	10 257	(9 740)	517	(4 836)	4 460	(376)
CLY	(8)	0	(8)	S/O	S/O	S/O
DUB	12 986	(12 970)	16	1 331	(2 120)	(789)
GLM	(7 033)	6 920	(113)	13 260	(12 310)	950
GST	(2)	0	(2)	(26)	0	(26)
HUS	S/O	S/O	S/O	(2 879)	2 270	(609)
IND	S/O	S/O	S/O	(1 607)	1 610	3
JPM	7 259	(7 080)	179	(536)	540	4
MBC	36 023	(33 640)	2 383	S/O	S/O	S/O
MEI	80	(4 040)	(3 960)	S/O	S/O	S/O
MYC	S/O	S/O	S/O	(43)	0	(43)
MYI	(126)	0	(126)	1 628	(1 210)	418
RBC	(3 115)	2 470	(645)	(2 095)	1 700	(395)
RYL	(7 748)	7 780	32	3 591	650	4 241
SCX	(15 297)	14 720	(577)	23 935	(19 060)	4 875
SOG	(1 445)	1 300	(145)	(125)	0	(125)
SSB	S/O	S/O	S/O	(49)	0	(49)
UAG	(341)	170	(171)	(1 551)	1 440	(111)

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	65,24	78,86
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	15,48	10,60
Autres valeurs mobilières	0,05	0,29
Fonds d'investissement	9,86	5,89
Contrats de mise en pension	2,44	2,65
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,48	(0,20)
Instruments financiers dérivés compensés	(1,15)	(0,16)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,61	0,37
Contrats de prise en pension	(0,35)	S/O

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Obligations et billets privés	3,28	4,09
Obligations et billets convertibles	0,26	0,21
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	1,78	0,70
Titres adossés à des actifs	6,77	4,43
Émissions souveraines	0,72	0,41
Actions ordinaires	39,19	48,53
Droits	0,00	S/O
Sociétés d'investissement immobilier	0,26	0,25
Instruments à court terme	28,51	31,13
Fonds d'investissement	9,86	5,89
Contrats de mise en pension	2,44	2,65
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,51	(0,20)
Options achetées		
Options sur indices	0,00	S/O
Options vendues		
Options sur indices	(0,03)	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,30	0,02
Swaps de taux d'intérêt	(1,45)	(0,18)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Options de change	0,14	S/O
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Options de change	(0,04)	S/O
Swaptions de taux d'intérêt	(0,05)	S/O

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	0,00	(0,01)
Swaps de rendement total sur indices	0,01	0,00
Contrats de change à terme	1,12	0,29
Contrats de change à terme couverts	(0,57)	0,09
Autres actifs et passifs à court terme	6,99	1,70
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
ARGENTINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement argentin				
0,500 % éch. 09/07/2030	$	5 624	$ 1 301	0,07
1,500 % éch. 09/07/2035		3 692	837	0,04
Obligations du Trésor argentin BONCER				
1,400 % éch. 25/03/2023	ARS	72 265	219	0,01
Ville autonome de Buenos Aires				
72,479 % éch. 29/03/2024 (a)		88 177	276	0,02
72,986 % éch. 22/02/2028 (a)		52 420	150	0,01
Letras de la Nacion Argentina con Ajuste por CER				
0,000 % éch. 19/05/2023 (d)		73 077	222	0,01
Total Argentine			3 005	0,16
AZERBAÏDJAN				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC				
7,230 % éch. 17/03/2026	$	4 500	4 399	0,23
BAHAMAS				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement des Bahamas				
9,000 % éch. 16/06/2029		3 000	2 580	0,13
BRÉSIL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco BTG Pactual S.A.				
8,300 % éch. 15/08/2024	BRL	228 000	40 836	2,13
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				
0,000 % éch. 30/01/2023 (d)(g)	$	485	1	0,00
Oi S.A.				
0,000 % éch. 25/02/2035	BRL	4 559	3 890	0,20
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL				
9,850 % éch. 16/07/2032		204 859	34 242	1,78
Vale S.A.				
0,000 % (g)		99 420	7 029	0,37
Total Brésil			85 998	4,48
ÎLES CAÏMANS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Interoceanica Finance Ltd.				
0,000 % éch. 30/11/2025 (d)	$	329	270	0,02
Kaisa Group Holdings Ltd.				
9,750 % éch. 28/09/2023 ^		8 000	1 126	0,06
10,500 % éch. 15/01/2025 ^		1 900	267	0,01
10,875 % éch. 23/07/2023 ^		500	70	0,00
11,700 % éch. 11/11/2025 ^		1 900	268	0,01
Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % en numéraire et 1,000 % de rémunération en nature)				
7,350 % éch. 01/12/2026 ^(b)		517	286	0,02
Poinsettia Finance Ltd.				
6,625 % éch. 17/06/2031		7 137	6 057	0,32
Total îles Caïmans			8 344	0,44
CHILI				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos				
2,300 % éch. 01/10/2028	CLP	8 705 000	8 557	0,45
4,500 % éch. 15/10/2023		175 555	205	0,01
4,700 % éch. 01/09/2030		7 200 000	8 157	0,42
5,000 % éch. 01/10/2028		17 520 000	19 918	1,04
6,000 % éch. 01/01/2043		1 520 000	1 981	0,10
7,000 % éch. 01/05/2034		530 000	719	0,04
Total Chili			39 537	2,06
CHINE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Flourish Century				
6,600 % éch. 04/02/2049 ^(i)	$	2 800	311	0,02

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation du gouvernement chinois				
2,700 % éch. 03/11/2026	CNY	96 600	$ 13 941	0,73
3,030 % éch. 11/03/2026		308 500	45 150	2,35
3,120 % éch. 05/12/2026		83 500	12 264	0,64
3,280 % éch. 03/12/2027		164 010	24 313	1,27
3,810 % éch. 14/09/2050		89 400	14 124	0,73
			109 792	**5,72**
Total Chine			110 103	5,74
COLOMBIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Empresas Publicas de Medellin ESP				
7,625 % éch. 10/09/2024	COP	7 839 000	1 448	0,07
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement colombien				
4,375 % éch. 21/03/2023		19 889 000	4 027	0,21
9,850 % éch. 28/06/2027		25 455 000	4 624	0,24
TES colombien				
6,250 % éch. 09/07/2036		42 072 100	5 019	0,26
7,000 % éch. 26/03/2031		30 696 900	4 463	0,23
7,000 % éch. 30/06/2032		3 962 300	555	0,03
7,250 % éch. 18/10/2034		62 308 900	8 517	0,45
7,250 % éch. 26/10/2050		16 745 900	1 971	0,10
9,250 % éch. 28/05/2042		107 902 000	16 118	0,84
République de Colombie				
1,000 % éch. 26/11/2025		21 806 500	3 857	0,20
1,000 % éch. 26/08/2026		19 930 500	3 517	0,19
1,000 % éch. 03/11/2027		100 736 000	15 761	0,82
1,000 % éch. 09/07/2036		1 772 000	212	0,01
			68 641	**3,58**
Total Colombie			70 089	3,65
RÉPUBLIQUE TCHÈQUE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de République tchèque				
0,950 % éch. 15/05/2030	CZK	727 940	24 171	1,26
1,200 % éch. 13/03/2031		235 000	7 749	0,40
2,000 % éch. 13/10/2033		29 600	986	0,05
2,750 % éch. 23/07/2029		426 500	16 392	0,86
4,200 % éch. 04/12/2036		149 900	6 122	0,32
Total République tchèque			55 420	2,89
DANEMARK				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Jyske Realkredit A/S				
1,500 % éch. 01/10/2053	DKK	0	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
1,000 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		0	0	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Realkredit Danmark A/S				
1,500 % éch. 01/10/2053	DKK	0	$ 0	0,00
			0	**0,00**
Total Danemark			0	0,00
RÉPUBLIQUE DOMINICAINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Billets de la Banque centrale de la République dominicaine				
12,000 % éch. 03/10/2025	DOP	310 500	5 316	0,28
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine				
8,900 % éch. 15/02/2023		1 106 650	19 621	1,02
Total République dominicaine			24 937	1,30
HONGRIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement hongrois				
5,000 % éch. 22/02/2027	€	7 190	7 624	0,40
INDONÉSIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement indonésien				
6,375 % éch. 15/08/2028	IDR	34 287 000	2 184	0,11
6,500 % éch. 15/02/2031		205 262 000	12 893	0,67
7,000 % éch. 15/09/2030		278 789 000	18 103	0,94
7,000 % éch. 15/02/2033		502 143 000	32 439	1,68
7,125 % éch. 15/06/2038		138 300 000	8 928	0,47
7,125 % éch. 15/06/2042		34 279 000	2 208	0,12
7,125 % éch. 15/06/2043		157 824 000	10 174	0,53
8,375 % éch. 15/03/2034		199 861 000	14 117	0,74
Total Indonésie			101 046	5,26
IRLANDE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Black Diamond CLO DAC				
2,316 % éch. 20/01/2032	€	868	906	0,05
BNPP AM Euro CLO DAC				
1,978 % éch. 15/04/2031		500	518	0,03
Carlyle Euro CLO DAC				
2,078 % éch. 15/01/2031		4 598	4 788	0,25
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
2,548 % éch. 15/11/2031		1 900	1 965	0,10
Dryden Euro CLO DAC				
2,622 % éch. 15/05/2034		7 400	7 675	0,40
Total Irlande			15 852	0,83
ISRAËL				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement israélien				
0,150 % éch. 31/07/2023	ILS	20 900	5 807	0,30
1,500 % éch. 30/11/2023		76 200	21 193	1,10
4,250 % éch. 31/03/2023		23 400	6 641	0,35
Total Israël			33 641	1,75

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CÔTE D'IVOIRE				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
République de Côte d'Ivoire				
6,608 % éch. 19/03/2027	€	7 110	$ 7 247	0,38
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Corsair International Ltd.				
5,473 % éch. 28/01/2027		6 500	6 885	0,36
5,823 % éch. 28/01/2029		2 800	2 958	0,15
Total Jersey, Îles Anglo-Normandes			9 843	0,51
KAZAKHSTAN				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Development Bank of Kazakhstan JSC				
8,950 % éch. 04/05/2023	KZT	492 250	1 019	0,05
LUXEMBOURG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature)				
3,000 % éch. 31/12/2026 (b)	$	335	198	0,01
MALAISIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement malaisien				
2,632 % éch. 15/04/2031	MYR	25 040	5 122	0,27
3,582 % éch. 15/07/2032		8 484	1 856	0,09
3,733 % éch. 15/06/2028		30 750	6 914	0,36
3,757 % éch. 22/05/2040		75 080	15 886	0,83
3,885 % éch. 15/08/2029		26 300	5 931	0,31
3,899 % éch. 16/11/2027		25 050	5 699	0,30
4,065 % éch. 15/06/2050		44 540	9 270	0,48
4,254 % éch. 31/05/2035		35 492	8 068	0,42
4,504 % éch. 30/04/2029		6 420	1 498	0,08
4,696 % éch. 15/10/2042		27 641	6 527	0,34
4,762 % éch. 07/04/2037		16 310	3 903	0,20
Émission d'investissement du gouvernement malaisien				
3,422 % éch. 30/09/2027		32 700	7 288	0,38
3,465 % éch. 15/10/2030		35 910	7 811	0,41
3,990 % éch. 15/10/2025		267 690	61 176	3,19
4,130 % éch. 09/07/2029		49 250	11 216	0,58
4,193 % éch. 07/10/2032		13 490	3 074	0,16
4,258 % éch. 26/07/2027		14 130	3 262	0,17
4,369 % éch. 31/10/2028		44 670	10 332	0,54
Total Malaisie			174 833	9,11

DESCRIPTION		ACTIONS		
MEXIQUE				
ACTIONS ORDINAIRES				
Hipotecaria Su Casita S.A. (c)		212 074	0	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
America Movil S.A.B. de C.V.				
8,460 % éch. 18/12/2036	MXN	1 800	80	0,01
Corp. GEO S.A.B. de C.V.				
8,875 % éch. 25/09/2014 ^	$	250	0	0,00
9,250 % éch. 30/06/2020 ^		700	0	0,00
Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V.				
9,620 % éch. 28/06/2018 ^	MXN	22 130	37	0,00
Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.				
8,790 % éch. 09/12/2014 ^		29 700	0	0,00
			117	**0,01**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement mexicain				
5,500 % éch. 04/03/2027		1 028 100	46 051	2,40
5,750 % éch. 05/03/2026		253 900	11 783	0,61
7,500 % éch. 03/06/2027		363 600	17 573	0,92
7,750 % éch. 29/05/2031	MXN	163 002	$ 7 727	0,40
7,750 % éch. 23/11/2034		12 500	580	0,03
7,750 % éch. 13/11/2042		283 300	12 702	0,66
8,000 % éch. 07/11/2047		278 900	12 778	0,67
8,500 % éch. 31/05/2029		608 600	30 354	1,58
8,500 % éch. 18/11/2038		318 000	15 458	0,80
10,000 % éch. 20/11/2036		9 600	527	0,03
			155 533	**8,10**
Total Mexique			155 650	8,11
PAYS-BAS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Republic of Angola Via Avenir BV				
9,687 % éch. 07/12/2023	$	3 160	3 113	0,16
12,639 % éch. 01/07/2023		689	694	0,04
Total Pays-Bas			3 807	0,20
NIGERIA				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BOI Finance BV				
7,500 % éch. 16/02/2027	€	4 800	4 137	0,22
PÉROU				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement péruvien				
5,350 % éch. 12/08/2040	PEN	6 500	1 276	0,07
5,400 % éch. 12/08/2034		10 400	2 190	0,11
5,940 % éch. 12/02/2029		99 800	24 025	1,25
6,150 % éch. 12/08/2032		12 106	2 798	0,15
6,350 % éch. 12/08/2028		3 500	873	0,05
6,900 % éch. 12/08/2037		30 200	7 126	0,37
8,200 % éch. 12/08/2026		22 628	6 215	0,32
Total Pérou			44 503	2,32
PHILIPPINES				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement philippin				
6,250 % éch. 14/01/2036	PHP	52 000	852	0,04
POLOGNE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement polonais				
1,250 % éch. 25/10/2030 (j)	PLN	30 486	4 672	0,24
1,750 % éch. 25/04/2032 (j)		26 500	3 971	0,21
2,500 % éch. 25/07/2027		19 800	3 765	0,20
2,750 % éch. 25/04/2028 (j)		243 700	45 702	2,37
2,750 % éch. 25/10/2029 (j)		107 700	19 307	1,01
3,750 % éch. 25/05/2027 (j)		72 600	14 648	0,76
Total Pologne			92 065	4,79
QATAR				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
QNB Finance Ltd.				
6,900 % éch. 23/01/2025	IDR	276 200 000	17 552	0,92
ROUMANIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement roumain				
3,650 % éch. 28/07/2025	RON	42 200	$ 8 379	0,44
3,700 % éch. 25/11/2024		9 700	1 979	0,10
4,150 % éch. 26/01/2028		46 800	8 595	0,45
4,500 % éch. 17/06/2024		212 500	44 441	2,31
4,750 % éch. 11/10/2034		62 000	9 821	0,51
4,850 % éch. 25/07/2029		6 600	1 200	0,06
5,000 % éch. 12/02/2029		12 600	2 358	0,12
Total Roumanie			76 773	3,99
RUSSIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement russe				
1,125 % éch. 20/11/2027	€	100	31	0,00
5,100 % éch. 28/03/2035	$	1 200	396	0,02
7,700 % éch. 23/03/2033	RUB	1 088 800	4 624	0,24
Total Russie			5 051	0,26
SERBIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement serbe				
4,500 % éch. 20/08/2032	RSD	371 800	2 790	0,15
AFRIQUE DU SUD				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banque de développement d'Afrique du Sud				
8,600 % éch. 21/10/2024 (i)	ZAR	221 300	12 807	0,67
Eskom Holdings SOC Ltd.				
0,000 % éch. 18/08/2027 (d)		100 100	2 886	0,15
0,000 % éch. 31/12/2032 (d)		254 000	3 097	0,16
			18 790	**0,98**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement sud-africain				
2,000 % éch. 31/01/2025 (f)		67 899	3 885	0,20
6,250 % éch. 31/03/2036		114 500	4 431	0,23
6,500 % éch. 28/02/2041		513 200	18 883	0,98
7,000 % éch. 28/02/2031		106 446	5 054	0,26
8,000 % éch. 31/01/2030		628 027	32 918	1,70
8,250 % éch. 31/03/2032		374 180	18 787	0,98
8,500 % éch. 31/01/2037		697 900	32 561	1,70
8,750 % éch. 31/01/2044		68 700	3 146	0,16
8,875 % éch. 28/02/2035		320 000	15 865	0,83
9,000 % éch. 31/01/2040		152 100	7 251	0,38
10,500 % éch. 21/12/2026		407 300	25 307	1,32
10,500 % éch. 21/12/2026 (j)		1 224 732	76 096	3,97
			244 184	**12,72**
Total Afrique du Sud			262 974	13,70
CORÉE DU SUD				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Export-Import Bank of Korea				
7,250 % éch. 07/12/2024	IDR	51 400 000	3 338	0,17

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
8,000 % éch. 15/05/2024	IDR	2 800 000	$ 183	0,01
Total Corée du Sud			3 521	0,18
SUPRANATIONALES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banque de développement asiatique				
4,700 % éch. 12/03/2024	MXN	68 600	3 239	0,17
Corp. Andina de Fomento				
6,770 % éch. 24/05/2028	COP	22 000 000	3 429	0,18
Société financière internationale				
8,000 % éch. 09/10/2023	IDR	6 900 000	451	0,02
Total Supranationales			7 119	0,37
TANZANIE				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Ministère des Finances et de la Planification, Gouvernement de la République unie de Tanzanie				
7,737 % éch. 26/04/2028	€	9 000	9 477	0,49
THAÏLANDE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais				
2,000 % éch. 17/06/2042	THB	72 330	1 696	0,09
2,875 % éch. 17/06/2046		73 500	1 888	0,10
3,300 % éch. 17/06/2038		253 119	7 397	0,38
3,390 % éch. 17/06/2037		1 344 200	40 432	2,11
3,400 % éch. 17/06/2036		340 500	10 247	0,53
3,450 % éch. 17/06/2043		667 230	19 558	1,02
Total Thaïlande			81 218	4,23
TURQUIE				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
SOCAR Turkey Enerji A/S				
4,214 % éch. 11/08/2026	€	9 900	10 090	0,53
ÉMIRATS ARABES UNIS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
ADCB Finance Cayman Ltd.				
7,500 % éch. 15/10/2029	IDR	29 000 000	1 850	0,10
8,160 % éch. 29/04/2029		323 000 000	21 133	1,10
			22 983	**1,20**
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
NMC OpCo Ltd.				
10,358 % éch. 25/03/2027	AED	28 858	7 779	0,40
Total Émirats arabes unis			30 762	1,60
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC				
3,000 % éch. 29/06/2027	$	550	393	0,02
Standard Chartered PLC				
7,776 % éch. 16/11/2025		2 000	2 062	0,11
			2 455	**0,13**
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Canada Square Funding PLC				
3,735 % éch. 17/01/2059	£	1 809	2 093	0,10
Polaris PLC				
4,682 % éch. 27/05/2057	£	350	$ 419	0,02
RMAC PLC				
4,206 % éch. 12/06/2046		1 332	1 594	0,08
Rochester Financing PLC				
4,126 % éch. 18/12/2044		1 868	2 167	0,11
Stratton Mortgage Funding PLC				
4,287 % éch. 12/03/2052		409	490	0,03
Tower Bridge Funding PLC				
4,151 % éch. 20/12/2063		1 383	1 622	0,08
Warwick Finance Residential Mortgages PLC				
0,000 % éch. 21/12/2049 (d)		0	502	0,03
			8 887	**0,45**
Total Royaume-Uni			11 342	0,58
ÉTATS-UNIS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Citigroup Mortgage Loan Trust				
4,549 % éch. 25/12/2036	$	1 298	732	0,04
4,689 % éch. 25/10/2036		446	292	0,01
GSAMP Trust				
4,439 % éch. 25/12/2046		458	230	0,01
4,479 % éch. 25/01/2037		903	549	0,03
Lehman XS Trust				
5,049 % éch. 25/01/2036 ^		1 607	1 478	0,08
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
5,539 % éch. 25/08/2037		665	552	0,03
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
4,619 % éch. 25/11/2036		7 266	4 392	0,23
4,689 % éch. 25/06/2036		173	150	0,01
5,544 % éch. 25/01/2035		1 732	1 525	0,08
NovaStar Mortgage Funding Trust				
4,559 % éch. 25/01/2037		1 764	629	0,03
Option One Mortgage Loan Trust				
4,609 % éch. 25/04/2037		492	341	0,02
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,124 % éch. 25/08/2035		96	92	0,00
Residential Asset Securities Corp. Trust				
6,039 % éch. 25/07/2035		2 345	2 280	0,12
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
4,609 % éch. 25/10/2037		5 334	3 584	0,19
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
4,709 % éch. 25/07/2036		1 300	1 221	0,06
			18 047	**0,94**

DESCRIPTION		ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ACTIONS ORDINAIRES				
ÉNERGIE				
Constellation Oil Services Holding S.A. « B » (c)(i)		376 971	41	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Ford Motor Credit Co. LLC				
4,535 % éch. 06/03/2025	£	400	459	0,03
JPMorgan Structured Products BV				
12,000 % éch. 04/01/2027 (i)	ZMW	32 075	1 223	0,07
Rio Oil Finance Trust				
8,200 % éch. 06/04/2028	$	3 064	3 110	0,16
9,250 % éch. 06/07/2024		1 158	1 175	0,06
9,750 % éch. 06/01/2027		601	625	0,03
			6 592	**0,35**
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Banc of America Mortgage Trust				
2,843 % éch. 25/02/2036 ^		1	1	0,00
BCAP LLC Trust				
2,980 % éch. 26/05/2037		3 457	3 074	0,16
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,255 % éch. 25/05/2047 ^		12	10	0,00
3,372 % éch. 25/03/2035		8	7	0,00
3,810 % éch. 25/01/2035		1	1	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,354 % éch. 25/10/2035 ^	$	282	$ 238	0,01
3,367 % éch. 25/04/2037		6 814	5 090	0,27
Citigroup Mortgage Loan Trust				
2,358 % éch. 25/03/2034		1	1	0,00
3,871 % éch. 25/09/2037 ^		2 815	2 422	0,13
Countrywide Alternative Loan Trust				
4,749 % éch. 25/04/2046		107	94	0,00
4,993 % éch. 20/12/2035		434	379	0,02
6,000 % éch. 25/06/2036		4 164	2 357	0,12
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
3,726 % éch. 25/11/2037		322	290	0,02
5,189 % éch. 25/03/2035		40	35	0,00
FWD Securitization Trust				
2,240 % éch. 25/01/2050		612	546	0,03
GSMPS Mortgage Loan Trust				
4,739 % éch. 25/01/2036		139	115	0,01
GSR Mortgage Loan Trust				
3,796 % éch. 25/01/2036 ^		4	4	0,00
Impac CMB Trust				
5,029 % éch. 25/03/2035		87	79	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust				
3,141 % éch. 25/11/2037		217	176	0,01
4,729 % éch. 25/11/2036		5 527	5 225	0,26
4,749 % éch. 25/02/2037		393	372	0,02
JPMorgan Resecuritization Trust				
2,500 % éch. 25/03/2056		181	171	0,01
Lehman XS Trust				
4,769 % éch. 25/09/2046		1 617	1 349	0,07
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
4,386 % éch. 25/06/2036		1	1	0,00
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
5,500 % éch. 25/03/2037 ^		308	238	0,01
Sequoia Mortgage Trust				
3,044 % éch. 20/01/2038 ^		238	190	0,01
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
4,539 % éch. 25/02/2037		621	546	0,03
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,266 % éch. 25/02/2037 ^		23	20	0,00
4,759 % éch. 25/05/2034		124	116	0,01
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				
4,479 % éch. 25/10/2036		282	258	0,01
			23 405	**1,21**
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Fannie Mae				
3,996 % éch. 01/07/2035		8	8	0,00
Total États-Unis			48 093	2,50
ÎLES VIERGES BRITANNIQUES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
1MDB Global Investments Ltd.				
4,400 % éch. 09/03/2023		6 000	5 874	0,31
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BILLETS DE TRÉSORERIE				
Constellation Brands, Inc.				
5,000 % éch. 10/01/2023		2 700	2 696	0,14
5,000 % éch. 11/01/2023		2 700	2 696	0,14
Duke Energy Corp.				
4,620 % éch. 17/01/2023		1 700	1 696	0,09
Energy Transfer Partners LP				
5,080 % éch. 05/01/2023		14 100	14 088	0,74
Entergy Corp.				
4,700 % éch. 12/01/2023		2 550	2 546	0,13
Oracle Corp.				
4,760 % éch. 27/01/2023		2 300	2 292	0,12
4,800 % éch. 26/01/2023		1 700	1 694	0,09
			27 708	**1,45**
BONS DU TRÉSOR HONGROIS				
18,250 % éch. 03/01/2023 (d)(e)	HUF	21 748 000	57 961	3,02

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS			
(0,255) % éch. 11/01/2023 (d)(e)	¥ 4 207 200	$ 31 887	1,66
(0,235) % éch. 11/01/2023 (d)(e)	1 451 600	11 002	0,57
(0,228) % éch. 11/01/2023 (d)(e)	1 987 200	15 061	0,78
		57 950	**3,01**
Total des Instruments à court terme		143 619	4,78
Total des Valeurs mobilières		**$ 1 772 984**	**92,35**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (h)	250 000	$ 2 200	0,11
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (h)	122 324	1 317	0,07
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (h)	2 453 310	24 582	1,28
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)	9 887 838	$ 98 424	5,13
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (h)	384 409	5 120	0,27
Total des Fonds d'investissement		**$ 131 643**	**6,86**

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	35	$ 28	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Court	03/2023	44	890	0,05
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	35	(179)	(0,01)
				$ 739	**0,04**
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ 739**	**0,04**

[1] Option de style contrat à terme standardisé.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Barclays Bank PLC	1,000 %	20/12/2023	€ 1 200	$ 2	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2023	$ 1 100	(10)	0,00
				$ (8)	0,00

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel		Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250 %	16/03/2032	INR	1 930 950	$ (1 490)	(0,08)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,500	21/09/2023		15 635 021	(527)	(0,03)
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/09/2031	SGD	2 160	(73)	0,00
À recevoir	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/09/2031		2 160	244	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	4,030	02/01/2023	BRL	184 300	(1 745)	(0,09)
À payer	CDI BRL à 1 an	4,038	02/01/2023		45 000	(426)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	4,070	02/01/2023		161 500	(1 526)	(0,08)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	4,605	02/01/2023		166 600	1 527	0,08
À payer	CDI BRL à 1 an	4,870	02/01/2024		326 700	(5 180)	(0,27)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,000	02/01/2023		94 400	(812)	(0,04)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	5,100	02/01/2024		50 600	773	0,04
À recevoir	CDI BRL à 1 an	5,160	02/01/2024		348 300	5 312	0,28
À recevoir	CDI BRL à 1 an	5,350	02/01/2023		52 700	441	0,02
À recevoir	CDI BRL à 1 an	5,360	02/01/2023		4 900	41	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	5,440	02/01/2023		19 900	(164)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,660	02/01/2025		183 200	(3 331)	(0,17)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,680	02/01/2024		19 200	(278)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,710	02/01/2025		66 100	(1 158)	(0,06)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,745	02/01/2023		66 700	(536)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,780	02/01/2023		9 800	(79)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	5,920	02/01/2023		2 600	(21)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	6,010	02/01/2025		34 000	(584)	(0,03)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,020	04/01/2027		36 800	826	0,04
À payer	CDI BRL à 1 an	6,030	02/01/2025		76 700	(1 309)	(0,07)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,050	02/01/2025		102 500	1 756	0,09
À payer	CDI BRL à 1 an	6,140	04/01/2027		528 200	(11 945)	(0,62)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,180	04/01/2027		79 900	1 755	0,09

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	CDI BRL à 1 an	6,230 %	02/01/2023	BRL 141 800	$ (1 077)	(0,06)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,245	04/01/2027	10 400	230	0,01
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,250	04/01/2027	27 100	592	0,03
À payer	CDI BRL à 1 an	6,375	02/01/2023	48 800	(365)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	6,410	04/01/2027	80 000	(1 720)	(0,09)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,450	04/01/2027	21 800	471	0,02
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,500	04/01/2027	62 500	1 358	0,07
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,510	04/01/2027	66 800	1 436	0,07
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,520	04/01/2027	93 600	1 997	0,10
À payer	CDI BRL à 1 an	6,675	02/01/2023	157 400	(1 141)	(0,06)
À payer	CDI BRL à 1 an	6,710	02/01/2025	13 900	(226)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,745	02/01/2025	231 100	3 749	0,20
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,810	02/01/2025	147 200	2 378	0,12
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,910	02/01/2023	80 000	708	0,04
À payer	CDI BRL à 1 an	6,950	04/01/2027	800	(17)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	6,990	04/01/2027	59 200	(1 220)	(0,06)
À payer	CDI BRL à 1 an	7,115	04/01/2027	82 200	(1 680)	(0,09)
À payer	CDI BRL à 1 an	7,160	02/01/2025	9 100	(155)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	7,170	02/01/2025	11 900	(203)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	7,170	04/01/2027	108 700	2 209	0,12
À recevoir	CDI BRL à 1 an	7,195	02/01/2023	319 800	2 617	0,14
À payer	CDI BRL à 1 an	7,305	04/01/2027	37 400	(754)	(0,04)
À payer	CDI BRL à 1 an	7,310	02/01/2024	46 400	(768)	(0,04)
À payer	CDI BRL à 1 an	7,480	02/01/2025	119 400	(1 835)	(0,10)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	7,770	04/01/2027	166 100	3 474	0,18
À payer	CDI BRL à 1 an	7,775	02/01/2024	117 500	(1 746)	(0,09)
À payer	CDI BRL à 1 an	7,800	04/01/2027	27 000	(524)	(0,03)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	8,075	02/01/2024	120 000	1 710	0,09
À payer	CDI BRL à 1 an	8,300	02/01/2024	65 600	(878)	(0,05)
À payer	CDI BRL à 1 an	8,355	04/01/2027	54 900	(1 291)	(0,07)
À payer	CDI BRL à 1 an	8,450	04/01/2027	102 700	(2 366)	(0,12)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	8,635	04/01/2027	65 500	1 196	0,06
À payer	CDI BRL à 1 an	8,640	04/01/2027	105 900	(1 933)	(0,10)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	8,675	04/01/2027	19 900	361	0,02
À recevoir	CDI BRL à 1 an	8,750	04/01/2027	282 400	5 740	0,30
À payer	CDI BRL à 1 an	8,805	04/01/2027	37 700	(787)	(0,04)
À payer	CDI BRL à 1 an	9,020	02/01/2023	98 600	(463)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	9,490	04/01/2027	104 000	(1 765)	(0,09)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	9,600	04/01/2027	48 900	804	0,04
À payer	CDI BRL à 1 an	9,750	02/01/2025	17 400	(210)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	9,760	02/01/2025	51 200	(619)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	9,780	02/01/2024	110 500	(973)	(0,05)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,120	04/01/2027	2 100	(29)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	10,206	04/01/2027	8 900	(116)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	10,240	04/01/2027	67 300	1 073	0,06
À payer	CDI BRL à 1 an	10,300	02/01/2025	50 300	(575)	(0,03)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	10,300	04/01/2027	77 600	1 232	0,06
À payer	CDI BRL à 1 an	10,665	02/01/2024	5 500	(37)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	10,755	02/01/2024	20 900	(135)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,833	02/01/2024	82 000	(510)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,860	02/01/2023	115 200	(323)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,898	02/01/2024	160 100	(982)	(0,05)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,995	02/01/2024	12 900	(73)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	10,995	04/01/2027	54 800	(462)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,020	04/01/2027	43 300	(358)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,045	04/01/2027	53 100	(432)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,048	04/01/2027	82 500	(670)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,050	04/01/2027	58 600	(475)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,055	04/01/2027	53 500	(432)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,065	02/01/2024	43 700	(234)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,065	04/01/2027	30 400	(244)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,130	04/01/2027	31 500	(247)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,140	04/01/2027	37 700	(294)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,148	02/01/2024	10 900	(55)	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,445	02/01/2025	72 300	290	0,02
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,505	02/01/2024	102 300	440	0,02
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,515	02/01/2025	140 000	522	0,03
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,535	02/01/2024	111 800	471	0,02
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,540	02/01/2024	101 600	426	0,02
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,543	02/01/2024	102 300	429	0,02
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,708	02/01/2025	13 400	40	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,734	02/01/2025	94 900	(311)	(0,02)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,740	02/01/2025	29 300	85	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,750	02/01/2025	29 500	85	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,800	02/01/2025	93 800	(287)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,835	02/01/2025	93 800	(277)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,845	02/01/2025	186 600	(477)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,870	02/01/2025	141 600	(351)	(0,02)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,935	02/01/2025	46 100	122	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	12,005	02/01/2025	177 400	(457)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,290	02/01/2024	111 700	(88)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,425	02/01/2025	172 800	(231)	(0,01)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance		Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,525 %	04/01/2027	BRL	29 300	$ 12	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,740	02/01/2025		133 400	(34)	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,765	02/01/2025		22 000	(9)	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,850	02/01/2025		67 400	(36)	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,190	02/01/2025		39 800	(58)	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,215	02/01/2025		40 300	(61)	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,400	02/01/2025		94 800	(193)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	13,995	02/01/2024		322 400	288	0,02
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,250	21/12/2027	CNY	151 070	(32)	0,00
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	16/03/2027		170 800	(265)	(0,01)
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,625	16/12/2025		30 320	24	0,00
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,750	21/12/2027		30 320	2	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	2,740	24/07/2024	COP	7 014 700	(123)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,090	26/11/2025		76 500 000	1 676	0,09
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,125	15/01/2026		3 301 000	79	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,130	17/07/2025		34 734 600	808	0,04
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,240	15/10/2025		77 435 000	(1 882)	(0,10)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,255	11/12/2025		57 933 000	1 297	0,07
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,620	26/11/2025		69 048 400	(1 735)	(0,09)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,680	03/11/2027		17 350 000	474	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,975	23/06/2027		11 832 300	329	0,02
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,005	20/08/2028		53 353 700	(1 596)	(0,08)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,060	26/11/2025		66 789 000	1 893	0,10
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,075	26/11/2025		21 848 700	621	0,03
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,090	26/11/2025		56 359 000	1 615	0,08
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,115	01/02/2031		14 558 000	397	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,120	01/02/2031		10 388 000	284	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,155	15/01/2031		5 060 000	143	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,690	26/11/2025		25 630 900	807	0,04
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,820	26/11/2025		63 629 600	(1 960)	(0,10)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,945	29/07/2026		35 000 000	1 224	0,06
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,175	28/05/2027		32 437 000	(1 189)	(0,06)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,670	26/11/2025		23 575 500	(621)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,675	18/06/2031		20 000 000	881	0,05
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,780	04/10/2026		35 370 900	(1 099)	(0,06)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,130	26/10/2026		10 907 100	310	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,140	03/11/2027		6 325 300	200	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,260	03/11/2027		17 357 500	532	0,03
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,290	03/11/2027		17 357 500	528	0,03
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,355	18/11/2027		9 235 100	274	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,380	03/11/2027		11 709 000	348	0,02
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,630	07/10/2031		12 820 000	(484)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,640	11/01/2027		31 028 800	804	0,04
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,650	03/11/2027		26 004 000	717	0,04
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,660	07/10/2031		6 347 000	(237)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,670	11/01/2027		47 000 000	1 208	0,06
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,690	07/10/2031		6 347 000	(235)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,885	31/01/2025		40 172 000	694	0,04
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,040	25/01/2027		30 993 600	712	0,04
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,080	02/02/2027		9 610 900	217	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,090	28/04/2028		1 944 500	49	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,130	31/01/2027		14 472 000	322	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,130	28/04/2028		687 200	16	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,140	01/02/2027		29 583 000	657	0,03
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,140	28/04/2028		2 061 800	48	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,380	21/01/2029		9 688 000	232	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,500	15/02/2025		22 196 000	325	0,02
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,585	14/02/2027		35 037 000	(663)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,855	22/02/2025		13 754 500	180	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,860	26/08/2026		12 602 700	204	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,890	08/04/2027		21 093 600	366	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,913	08/04/2027		32 467 300	558	0,03
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,940	08/04/2027		16 342 600	278	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,020	08/04/2025		53 651 900	710	0,04
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,200	11/03/2027		45 342 000	(649)	(0,03)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,240	15/03/2027		15 813 700	(222)	(0,01)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,320	31/03/2027		10 203 000	(135)	(0,01)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,360	02/06/2027		58 618 000	(788)	(0,04)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,560	30/03/2027		4 356 600	(51)	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,610	26/11/2025		15 715 400	172	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,686	30/03/2027		25 932 000	(279)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,720	26/11/2025		23 335 000	242	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,960	09/06/2025		64 923 500	(565)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,055	26/08/2026		16 741 600	145	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,177	26/11/2025		18 899 000	150	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,270	26/11/2025		34 576 000	258	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,310	26/11/2025		40 887 100	297	0,02
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,325	12/07/2027		45 452 000	(300)	(0,02)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,430	26/11/2025		77 000 000	(510)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,430	16/06/2027		26 792 900	149	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,470	06/07/2025		26 426 500	(176)	(0,01)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,490	30/06/2032		9 544 300	(34)	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,830	26/03/2031		4 395 000	2	0,00

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel		Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,840 %	03/11/2027	COP	27 201 700	$ 61	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,920	13/09/2027		33 559 000	(52)	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,110	26/11/2025		9 311 000	28	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,180	03/11/2027		14 025 400	(7)	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,400	21/11/2029		4 122 900	(22)	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,420	02/12/2027		10 311 000	26	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,500	26/11/2025		49 157 500	(49)	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,720	18/11/2025		45 299 900	5	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,800	02/12/2025		102 940 000	61	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,820	02/12/2025		25 672 100	18	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,950	19/12/2024		41 386 700	(31)	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,990	21/11/2025		16 209 500	(25)	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,030	21/11/2025		15 885 200	(28)	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,640	21/10/2025		37 195 000	(184)	(0,01)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,930	10/11/2025		19 843 000	129	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	12,000	26/11/2025		1 431 000	(10)	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	12,060	09/11/2025		14 050 000	101	0,01
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	3,210	17/06/2025	ILS	7 100	11	0,00
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	1,750	15/12/2026	KRW	107 046 200	(6 173)	(0,32)
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	1,750	15/12/2026		107 046 200	(372)	(0,02)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	1,750	15/12/2031		53 394 300	(1 935)	(0,10)
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	1,750	15/12/2031		53 394 300	5 631	0,29
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	5,750	02/03/2024	ZAR	771 100	1 049	0,05
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	5,757	14/04/2026		335 500	(1 132)	(0,06)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	6,124	08/03/2024		587 600	647	0,03
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	6,635	04/02/2027		53 800	15	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	6,956	11/03/2027		157 800	(373)	(0,02)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	6,991	31/03/2027		215 900	(503)	(0,03)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,120	26/05/2030		88 500	(405)	(0,02)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,205	22/04/2027		178 200	323	0,02
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,210	22/04/2027		137 000	247	0,01
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,250	19/09/2023		142 300	(607)	(0,03)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,490	06/03/2030		53 400	277	0,01
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,740	17/08/2027		103 100	94	0,00
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	8,180	05/07/2027		95 700	(30)	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	8,500	17/10/2027		177 400	231	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,020	01/03/2025	CLP	6 193 000	742	0,04
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,025	01/03/2025		6 451 000	774	0,04
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,030	01/03/2025		8 262 000	992	0,05
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,150	24/07/2025		290 500	(39)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,165	14/07/2025		6 564 000	(914)	(0,05)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,170	14/07/2025		6 564 000	(914)	(0,05)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,220	14/07/2025		13 854 000	(1 950)	(0,10)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,470	01/03/2025		12 050 000	(1 599)	(0,08)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,582	02/02/2026		9 746 000	(1 377)	(0,07)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,684	04/06/2027		18 963 600	(1 749)	(0,09)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,715	04/06/2027		3 782 600	(354)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,740	09/12/2025		7 836 000	(882)	(0,05)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,780	17/02/2026		7 036 000	1 000	0,05
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,785	17/02/2026		3 197 000	455	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,790	17/02/2026		12 255 000	1 745	0,09
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,840	13/03/2025		457 000	63	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,935	10/03/2025		9 206 000	1 311	0,07
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,940	10/03/2025		4 602 900	656	0,03
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,947	23/11/2027		9 776 000	1 003	0,05
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,950	05/05/2026		5 894 100	(687)	(0,04)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,965	24/11/2027		8 553 000	881	0,05
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,080	01/06/2030		3 688 000	(288)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,110	01/06/2030		1 385 000	(110)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,120	14/07/2030		7 000 000	809	0,04
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,170	14/07/2030		7 199 000	846	0,04
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,245	10/12/2027		1 305 000	(141)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,255	10/12/2027		6 892 000	(748)	(0,04)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,260	10/09/2027		7 948 100	1 037	0,05
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,300	05/09/2026		4 789 900	701	0,04
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,305	10/03/2026		2 958 700	443	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,325	10/03/2026		1 972 500	297	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,335	03/09/2026		2 007 400	297	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,340	08/10/2027		2 970 700	363	0,02
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,565	27/11/2030		2 740 000	(268)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,580	05/02/2026		5 159 000	(884)	(0,05)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,585	27/11/2030		2 730 000	(270)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,640	01/03/2026		10 523 000	1 727	0,09
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,740	10/12/2030		5 395 000	(547)	(0,03)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,770	12/02/2031		2 650 000	(336)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,000	07/01/2030		4 970 000	(803)	(0,04)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,030	19/07/2025		12 024 100	(1 808)	(0,09)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,060	08/01/2030		4 500 000	(737)	(0,04)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,120	05/02/2030		1 679 000	(262)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,215	14/01/2030		9 767 400	1 642	0,09
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,420	01/09/2030		3 448 000	509	0,03
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,470	15/06/2028		17 495 300	2 226	0,12
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,475	19/07/2027		8 288 650	1 273	0,07

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,520 %	14/06/2028	CLP 2 761 600	$ 344	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,530	06/07/2026	5 681 000	826	0,04
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,530	06/08/2026	6 336 400	879	0,05
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,640	30/04/2031	4 264 000	581	0,03
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,725	19/07/2028	2 502 900	379	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,731	20/07/2028	13 716 000	2 023	0,11
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,920	06/08/2028	9 384 500	1 241	0,06
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,990	06/07/2028	5 482 000	748	0,04
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	4,000	06/07/2028	2 901 000	388	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	4,410	01/09/2030	2 839 400	284	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	4,660	14/09/2026	3 793 000	(319)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	4,690	14/09/2026	1 821 600	(151)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	4,870	15/11/2026	3 806 000	(236)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	4,870	01/10/2028	3 460 000	(222)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,015	13/09/2028	1 869 500	(111)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,030	13/09/2028	6 500 000	(379)	(0,02)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,045	14/12/2026	2 269 200	110	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,100	15/11/2031	731 000	(19)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,120	15/11/2031	731 000	(18)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,130	01/03/2025	4 395 000	336	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,180	01/10/2028	1 905 000	86	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,240	01/09/2030	3 103 000	110	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,250	01/10/2028	7 411 400	238	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,260	01/03/2026	4 550 000	299	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,370	01/10/2028	1 735 700	59	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,400	01/10/2028	949 000	30	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,420	01/10/2028	2 094 000	64	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,460	01/10/2028	952 100	19	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,470	01/09/2030	3 420 000	60	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,570	01/10/2028	1 925 000	42	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,590	15/11/2032	4 589 900	74	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,600	12/12/2027	3 791 000	54	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,610	08/02/2027	9 105 000	(407)	(0,02)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,635	12/12/2027	7 773 000	96	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,640	21/11/2032	9 072 200	199	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,680	01/10/2028	2 490 200	15	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,755	08/03/2032	4 456 700	86	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,820	01/09/2030	5 080 500	(114)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,835	12/10/2031	1 482 900	44	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,865	14/01/2027	3 024 900	(112)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,890	17/03/2032	1 533 000	(52)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,910	21/01/2027	5 517 100	(186)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,910	14/11/2032	439 400	20	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,920	08/10/2031	973 000	36	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,930	17/03/2032	1 533 100	(57)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,940	01/03/2025	4 450 000	(243)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,975	11/02/2027	8 621 000	(231)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,000	11/02/2027	16 819 000	(430)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,000	01/10/2028	5 006 600	22	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,010	16/02/2029	2 164 000	5	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,020	02/03/2029	1 250 400	7	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,030	10/02/2027	6 830 000	(167)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,055	10/02/2027	4 654 000	(109)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,100	01/04/2032	1 225 000	(67)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,110	01/09/2030	3 599 900	117	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,115	01/04/2032	1 273 000	(71)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,120	08/03/2027	10 373 600	160	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,130	16/02/2027	2 866 000	(54)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,140	28/06/2032	623 200	45	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,195	04/03/2027	3 008 200	(37)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,195	04/04/2028	4 230 000	40	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,250	01/10/2028	1 580 100	31	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,255	08/04/2032	3 198 000	(223)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,260	08/04/2032	3 004 000	(211)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,270	02/03/2027	2 736 000	(26)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,299	08/04/2032	3 373 000	(249)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,300	11/03/2027	10 495 100	65	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,333	05/04/2027	3 323 000	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,350	15/03/2027	1 288 500	4	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,350	04/04/2027	3 495 000	2	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,360	25/05/2027	3 858 600	46	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,370	29/06/2029	4 532 000	236	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,380	03/06/2027	9 491 000	156	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,386	24/05/2027	11 557 400	150	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,420	24/03/2029	1 107 000	40	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,460	03/11/2032	67 100	6	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,470	28/06/2027	8 573 100	211	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,470	01/10/2028	3 085 000	(119)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,480	01/04/2027	2 449 000	16	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,495	01/04/2027	2 228 000	16	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,500	12/12/2025	5 668 000	55	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,500	01/10/2028	2 650 000	(107)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,550	15/06/2032	2 352 600	253	0,01

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance		Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,567 %	12/12/2025	CLP	2 575 000	$ 18	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,580	01/10/2028		3 089 700	(139)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,590	16/06/2032		6 916 000	769	0,04
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,610	17/06/2032		2 813 000	320	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,625	04/04/2025		11 033 000	332	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,628	04/04/2025		16 183 000	486	0,03
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,635	23/03/2027		3 805 000	(45)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,640	01/10/2028		1 614 000	(78)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,650	01/10/2028		3 129 000	(153)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,650	20/07/2032		2 352 400	229	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,670	05/04/2025		10 709 000	306	0,02
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,670	14/06/2030		1 602 000	139	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,765	09/06/2027		12 547 900	(421)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,800	05/07/2027		6 650 000	113	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,850	01/03/2026		1 660 000	(11)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,000	27/09/2032		67 900	9	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,030	28/03/2027		2 697 100	84	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,040	10/05/2027		3 264 700	(131)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,090	22/07/2029		7 495 700	(598)	(0,03)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,100	18/11/2024		5 248 800	103	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,110	15/06/2027		4 107 000	(209)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,150	15/06/2027		9 495 000	(500)	(0,03)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,160	16/06/2027		28 123 000	(1 499)	(0,08)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,160	22/06/2027		3 224 200	174	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,160	01/10/2028		2 439 300	182	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,195	01/10/2028		1 355 100	104	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,214	21/09/2025		8 657 000	(27)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,270	15/09/2027		6 333 000	(341)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,325	23/03/2025		11 983 000	(158)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,390	15/11/2024		19 628 700	275	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,420	14/07/2027		595 100	30	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,520	25/08/2027		1 466 100	(93)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,540	13/06/2025		6 833 300	59	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,550	21/11/2024		41 237 200	386	0,02
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,550	13/06/2025		6 855 400	61	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,610	29/08/2027		1 753 000	120	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,690	10/05/2025		1 573 600	9	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,780	14/11/2024		1 849 600	11	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	8,230	04/08/2025		6 982 600	(151)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	8,690	19/07/2025		10 594 100	(333)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	8,740	29/08/2025		1 250 000	52	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	9,135	01/03/2025		14 196 000	457	0,02
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	9,270	01/03/2025		10 647 000	381	0,02
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	9,300	01/03/2025		13 761 900	510	0,03
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	9,350	01/03/2025		3 976 300	(154)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	9,370	01/03/2025		4 040 000	(159)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	9,820	15/09/2024		9 152 900	(258)	(0,01)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	0,650	31/03/2030	CZK	31 300	224	0,01
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	0,800	11/05/2030		468 900	3 322	0,17
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	0,929	13/03/2030		266 700	2 017	0,11
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,477	04/02/2030		358 600	(2 989)	(0,16)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,733	08/03/2031		66 300	(596)	(0,03)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,872	05/08/2026		65 000	(231)	(0,01)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,890	15/01/2030		353 500	(3 110)	(0,16)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	2,000	20/06/2028		69 000	(405)	(0,02)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	2,015	10/08/2026		267 200	(1 019)	(0,05)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	2,250	19/12/2023		669 100	(1 993)	(0,10)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	2,715	20/10/2031		546 200	(527)	(0,03)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	3,490	18/01/2032		412 200	1 760	0,09
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	3,530	27/12/2026		106 100	(243)	(0,01)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	3,770	11/02/2027		136 000	(294)	(0,02)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	3,930	18/01/2027		772 500	(1 679)	(0,09)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,164	14/03/2027		277 100	402	0,02
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,220	14/03/2027		629 100	842	0,04
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,310	15/03/2027		103 600	119	0,01
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,320	15/03/2027		39 100	44	0,00
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,490	25/03/2027		157 050	116	0,01
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,560	25/03/2027		157 050	95	0,00
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,570	12/07/2032		24 000	33	0,00
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,675	20/09/2032		198 900	100	0,01
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,700	29/03/2027		188 300	61	0,00
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,700	20/09/2032		376 700	243	0,01
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,138	14/11/2027		201 200	(68)	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,180	14/11/2027		312 900	(81)	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,220	07/07/2027		185 200	(120)	(0,01)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,340	07/07/2027		186 500	(77)	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,600	11/11/2027		173 400	93	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,606	28/06/2027		181 200	312	0,02
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	6,221	17/06/2027		354 500	1 035	0,05
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,500	19/06/2024	HUF	8 026 600	(3 107)	(0,16)
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,760	21/01/2030		1 296 900	(335)	(0,02)
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,770	24/02/2026		3 010 400	(2 110)	(0,11)
À payer	BBR HUF à 6 mois	2,420	02/08/2026		3 964 700	(3 228)	(0,17)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance		Montant notionnel		Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	BBR HUF à 6 mois	2,680 %	29/06/2031	HUF	1 938 800	$	(1 572)	(0,08)
À payer	BBR HUF à 6 mois	4,790	17/01/2027		7 857 000		(4 277)	(0,22)
À payer	BBR HUF à 6 mois	8,670	23/05/2029		1 828 200		(251)	(0,01)
À payer	BBR HUF à 6 mois	9,230	26/08/2032		1 440 400		(134)	(0,01)
À payer	BBR HUF à 6 mois	9,240	02/09/2032		673 500		(64)	0,00
À payer	BBR HUF à 6 mois	10,570	22/08/2027		5 227 600		(439)	(0,02)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	13,550	12/12/2024		1 598 400		30	0,00
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	13,600	12/12/2024		4 521 500		76	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	0,663	25/06/2027	PLN	21 300		378	0,02
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	0,925	16/10/2030		1 500		(76)	0,00
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	1,097	25/02/2027		136 300		(4 999)	(0,26)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	1,163	03/12/2030		32 800		(1 696)	(0,09)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	1,280	08/02/2031		23 500		1 324	0,07
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	1,460	28/05/2026		44 900		(1 484)	(0,08)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	1,490	29/08/2029		57 400		3 014	0,16
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	1,930	05/10/2026		59 500		(2 014)	(0,11)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	2,585	14/10/2029		15 200		615	0,03
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	2,920	13/12/2031		31 400		1 566	0,08
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	4,075	07/03/2027		82 000		1 249	0,07
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	4,135	08/02/2027		48 000		(719)	(0,04)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	4,320	09/03/2027		20 100		256	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	4,350	09/03/2027		20 100		250	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	4,885	22/03/2027		52 300		362	0,02
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,175	24/03/2027		38 700		152	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,285	25/03/2027		41 900		120	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,290	25/03/2027		42 300		119	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,340	28/03/2027		20 800		49	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,470	08/04/2027		64 800		62	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,550	08/04/2027		40 400		7	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,575	08/04/2027		40 400		(3)	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,870	22/04/2027		1 000		(3)	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,960	25/04/2027		67 900		(249)	(0,01)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,980	13/04/2027		58 600		240	0,01
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,985	13/04/2027		59 400		246	0,01
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,010	13/04/2027		59 500		261	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,210	26/04/2027		19 800		(121)	(0,01)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,260	25/04/2032		24 200		55	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,300	25/04/2028		23 400		(111)	(0,01)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,456	25/05/2027		40 800		(285)	(0,01)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,480	25/05/2027		45 100		(192)	(0,01)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,495	25/05/2027		37 400		(265)	(0,01)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,560	25/05/2027		15 800		(125)	(0,01)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,650	29/09/2027		38 200		(144)	(0,01)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,725	27/06/2027		17 900		(218)	(0,01)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,745	05/07/2027		88 500		344	0,02
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,755	10/05/2027		47 000		540	0,03
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,830	19/08/2024		52 600		76	0,00
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,843	28/06/2027		52 600		701	0,04
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,890	22/08/2024		119 500		140	0,01
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,940	09/06/2027		95 100		1 325	0,07
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	7,310	30/06/2027		37 000		(664)	(0,03)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	7,725	23/06/2027		43 700		959	0,05
À payer	TIIE MXN à 28 jours	4,610	27/06/2024	MXN	496 500		(1 171)	(0,06)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,405	26/12/2030		740 000		3 022	0,16
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,445	05/12/2030		199 200		(820)	(0,04)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,540	31/12/2030		143 700		(596)	(0,03)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,590	03/07/2030		172 600		705	0,04
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,610	03/07/2030		393 000		1 612	0,08
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,865	13/06/2030		226 900		(1 002)	(0,05)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,870	12/06/2030		116 800		(517)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,880	13/06/2030		140 000		(620)	(0,03)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,893	05/06/2030		282 900		1 220	0,06
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,940	23/05/2030		82 600		365	0,02
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,980	12/02/2031		111 200		(489)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,990	12/02/2031		264 600		(1 164)	(0,06)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,040	02/05/2030		87 300		389	0,02
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,040	12/02/2031		951 600		(4 223)	(0,22)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,060	16/05/2030		102 300		466	0,02
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,095	29/05/2030		18 700		84	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,260	07/06/2040		139 400		566	0,03
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,288	25/04/2030		230 700		1 078	0,06
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,380	25/02/2025		89 900		(361)	(0,02)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,380	05/06/2040		146 300		612	0,03
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,430	04/06/2040		88 600		375	0,02
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,435	18/05/2040		61 000		256	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,463	18/05/2040		76 000		321	0,02
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,465	26/09/2040		94 900		402	0,02
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,480	28/05/2040		342 800		1 484	0,08
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,510	24/02/2025		692 800		(2 847)	(0,15)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,540	31/05/2040		240 300		1 049	0,05
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,545	30/05/2040		75 100		329	0,02
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,550	04/04/2031		160 200		779	0,04
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,600	13/01/2025		341 200		(1 388)	(0,07)

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,600 %	26/02/2030	MXN 41 200	$ 202	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,623	17/05/2040	132 400	580	0,03
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,630	31/03/2031	272 600	1 348	0,07
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,635	31/03/2031	330 000	1 633	0,09
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,678	29/05/2031	445 400	(2 782)	(0,15)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,715	30/05/2031	473 100	(2 899)	(0,15)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,755	29/04/2031	226 900	1 142	0,06
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,065	26/12/2039	142 800	693	0,04
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,070	27/08/2031	283 800	1 452	0,08
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,100	13/06/2031	316 400	1 828	0,10
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,127	10/08/2039	204 800	(1 009)	(0,05)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,180	31/10/2039	118 500	589	0,03
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,200	31/10/2039	102 500	512	0,03
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,210	28/10/2039	49 700	249	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,253	28/10/2039	99 600	502	0,03
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,418	27/10/2031	52 300	(219)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,525	26/09/2031	214 200	(798)	(0,04)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,533	07/01/2027	173 300	(420)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,600	08/10/2031	66 300	(236)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,625	12/07/2039	163 200	(883)	(0,05)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,640	13/07/2039	117 200	(635)	(0,03)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,643	18/11/2031	158 900	542	0,03
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,650	24/09/2031	32 600	(109)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,650	29/09/2031	30 420	(104)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,675	09/06/2039	438 200	(2 397)	(0,13)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,690	16/10/2031	90 000	(293)	(0,02)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,784	13/11/2031	445 300	1 328	0,07
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,800	13/11/2031	120 600	354	0,02
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,875	17/02/2032	189 800	(531)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,885	27/05/2039	470 900	(2 649)	(0,14)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,895	21/02/2040	200 000	(1 126)	(0,06)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,900	19/02/2032	144 300	(391)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,950	20/02/2032	151 500	(385)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,990	17/02/2040	15 800	(90)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,035	31/05/2029	232 700	427	0,02
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,050	24/02/2032	237 500	(524)	(0,03)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,080	31/05/2029	122 500	211	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,103	04/01/2038	6 300	37	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,120	04/03/2027	321 700	452	0,02
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,135	31/05/2029	80 900	128	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,140	04/03/2027	176 100	241	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,180	04/03/2027	287 900	373	0,02
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,300	17/02/2040	123 300	(742)	(0,04)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,320	07/01/2032	195 200	(1 217)	(0,06)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,414	14/12/2027	310 400	269	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,431	24/05/2027	575 800	486	0,03
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,465	16/08/2027	38 900	30	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,515	17/12/2027	198 600	128	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,680	30/03/2032	234 300	(41)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,700	05/11/2027	36 700	(11)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,740	30/08/2027	147 500	(31)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,743	05/11/2027	160 400	(35)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,750	05/04/2024	914 300	756	0,04
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,750	30/08/2027	292 200	(56)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,760	05/11/2027	107 500	(20)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,773	05/11/2027	159 300	(25)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,915	04/03/2027	55 800	(1)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,940	22/05/2024	1 038 700	1 131	0,06
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,975	03/06/2027	173 600	33	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,018	07/07/2027	175 100	(53)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,045	04/11/2027	86 800	34	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,053	04/11/2027	95 000	39	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,060	18/06/2027	319 300	(110)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,070	04/06/2026	86 800	3	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,090	08/07/2027	202 800	(90)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,117	04/11/2027	237 200	128	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,165	05/11/2026	128 900	45	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,260	04/10/2032	20 900	(36)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,335	02/08/2023	1 952 800	1 038	0,05
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,350	13/10/2032	82 400	169	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,360	11/10/2027	170 300	175	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,470	11/10/2032	66 300	162	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,500	03/07/2023	3 190 100	(1 325)	(0,07)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,525	22/09/2027	95 400	127	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,580	30/06/2023	1 796 800	(679)	(0,04)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,600	21/09/2027	86 200	128	0,01
					$ (19 792)	(1,03)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ (19 800)**	**(1,03)**

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

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

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

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

OPTIONS ACHETÉES

OPTIONS DE CHANGE

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - EUR contre CZK hors cote	CZK 23,830	01/11/2023	3 137	$ 327	$ 595	0,03
	Option d'achat - USD contre INR hors cote	INR 92,600	16/06/2025	2 200	132	43	0,00
	Option de vente - USD contre INR hors cote	92,600	16/06/2025	2 200	132	168	0,01
GLM	Option de vente - EUR contre HUF hors cote	HUF 385,000	01/11/2023	788	105	112	0,01
	Option de vente - EUR contre PLN hors cote	PLN 4,560	01/11/2023	3 150	349	479	0,02
JPM	Option d'achat - AUD contre USD hors cote	$ 0,735	04/05/2023	3 540	213	354	0,02
	Option de vente - EUR contre HUF hors cote	HUF 385,000	01/11/2023	1 581	151	224	0,01
MBC	Option de vente - USD contre MXN hors cote	MXN 18,310	04/05/2023	2 143	214	156	0,01
MYI	Option de vente - USD contre BRL hors cote	BRL 4,450	04/05/2023	2 082	208	64	0,00
	Option de vente - USD contre ZAR hors cote	ZAR 15,925	04/05/2023	2 082	208	374	0,02
					$ 2 039	$ 2 569	0,13

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE CHANGE

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
MYI	Option d'achat - USD contre MXN hors cote	MXN 20,500	28/02/2023	18 449	$ (187)	$ (118)	(0,01)

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067 %	09/06/2023	5 300	$ (67)	$ (14)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	5 300	(71)	(173)	(0,01)
							$ (138)	$ (187)	(0,01)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement du Monténégro	1,000 %	20/06/2023	€ 800	$ (62)	$ 51	$ (11)	0,00
BPS	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/12/2023	$ 500	2	0	2	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	1 800	(3)	6	3	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	16 200	(1 920)	951	(969)	(0,05)
CBK	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	3 500	(405)	196	(209)	(0,01)
DUB	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	2 900	(335)	161	(174)	(0,01)
GST	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/12/2023	1 200	4	1	5	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	3 100	(361)	176	(185)	(0,01)
JPM	Obligation internationale du gouvernement du Ghana	5,000	20/06/2024	1 400	4	(926)	(922)	(0,05)
MYC	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	2 900	(332)	159	(173)	(0,01)
					$ (3 408)	$ 775	$ (2 633)	(0,14)

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

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

SWAPS SUR DEVISES CROISÉES

Contrepartie	À recevoir	À payer	Date d'échéance	Montant notionnel de la devise reçue	Montant notionnel de la devise livrée	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	Taux variable égal à LIBOR USD à 6 mois plus 0,330 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR ARS à 6 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	28/05/2024	USD 1 900	ARS 85 633	$ 0	$ 1 750	$ 1 750	0,09

Contrepartie	À recevoir	À payer	Date d'échéance	Montant notionnel de la devise reçue		Montant notionnel de la devise livrée		Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
	Taux variable égal à LIBOR USD à 6 mois plus 0,333 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR ARS à 6 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	30/05/2024	USD 4 820		ARS 214 249		$ (15)	$ 4 456	$ 4 441	0,23
	Taux variable égal à LIBOR USD à 6 mois plus 0,282 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR ARS à 6 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	07/06/2027	2 090		93 789		(3)	1 946	1 943	0,10
SCX	Taux variable égal à LIBOR IDR à 3 mois plus 0,067 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	23/09/2029	18 851	IDR	283 145 680		47	(87)	(40)	0,00
								$ 29	$ 8 065	$ 8 094	0,42

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance		Montant notionnel		Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,295 %	08/09/2025	ILS	89 000		$ 0	$ 2 213	$ 2 213	0,11
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,680	08/09/2030		44 500		0	(2 475)	(2 475)	(0,13)
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,800	24/04/2028		120 000		0	4 658	4 658	0,24
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,963	16/02/2028		21 300		0	(397)	(397)	(0,02)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,998	20/06/2028		13 700		0	(280)	(280)	(0,02)
BRC	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,795	20/06/2028		32 000		0	1 245	1 245	0,06
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,950	20/06/2028		34 500		0	(732)	(732)	(0,04)
BSH	À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,300	21/06/2029	CLP	3 450 000		0	539	539	0,03
	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,750	22/03/2026		8 000 000		0	(964)	(964)	(0,05)
	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,790	14/03/2026		3 885 000		7	(476)	(469)	(0,02)
CBK	À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,960	10/05/2029	COP	27 236 900		0	1 028	1 028	0,05
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,485	09/08/2024	ILS	68 500		0	1 064	1 064	0,05
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,950	23/05/2024		122 500		0	1 287	1 287	0,07
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,041	15/05/2024		101 800		0	(1 010)	(1 010)	(0,05)
	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,763	24/05/2029	CLP	1 841 700		11	(247)	(236)	(0,01)
	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,770	19/03/2026		64 800		0	(8)	(8)	0,00
CKL	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	2,100	20/06/2028	ILS	14 000		(46)	(219)	(265)	(0,01)
DUB	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,690	27/09/2027		20 100		0	720	720	0,04
GLM	À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,708	02/01/2025	BRL	18 800		0	56	56	0,00
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,235	15/01/2023	ILS	198 900		0	(314)	(314)	(0,02)
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,520	12/08/2024		93 500		0	1 434	1 434	0,07
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,540	11/05/2027		11 600		0	(411)	(411)	(0,02)
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,720	20/06/2028		8 800		0	352	352	0,02
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,820	15/01/2030		43 800		0	2 136	2 136	0,11
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,950	23/05/2024		75 700		0	795	795	0,04
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,960	24/05/2024		70 700		0	736	736	0,04
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,048	27/02/2024		132 400		0	(974)	(974)	(0,05)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,883	21/03/2028		28 100		0	(558)	(558)	(0,03)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,898	17/12/2025		57 400		0	(819)	(819)	(0,04)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,971	16/02/2028		43 600		0	(806)	(806)	(0,04)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,998	20/06/2028		28 300		0	(579)	(579)	(0,03)
	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,990	01/08/2029	CLP	2 813 100		0	(586)	(586)	(0,03)
	À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,015	20/06/2026		5 555 000		0	710	710	0,04
	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,265	14/06/2029		4 122 200		0	(636)	(636)	(0,03)
	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,830	22/05/2029		7 729 900		0	(949)	(949)	(0,05)
	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	4,095	01/06/2027		12 230 000		0	(1 157)	(1 157)	(0,06)
	À payer[1]	CHILIBOR CLP à 6 mois	4,319	22/05/2029		19 808 000		0	(322)	(322)	(0,02)
HUS	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,018	11/03/2024	ILS	82 600		0	(622)	(622)	(0,03)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,018	15/05/2024		91 500		0	(920)	(920)	(0,05)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,998	20/06/2028		14 900		1	(306)	(305)	(0,02)
JPM	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,475	09/08/2024		71 500		0	1 115	1 115	0,06
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,813	20/06/2028		18 100		0	699	699	0,04
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,027	19/03/2024		37 000		0	(278)	(278)	(0,01)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,095	10/05/2024		19 800		0	(191)	(191)	(0,01)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	2,078	20/06/2028		12 600		0	(242)	(242)	(0,01)
	À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,540	04/06/2029	CLP	4 115 000		0	581	581	0,03
MYC	À payer	CDI BRL à 1 an	7,800	04/01/2027	BRL	12 200		17	(209)	(192)	(0,01)
								$ (10)	$ 3 681	$ 3 671	0,19

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

SWAPS DE VOLATILITÉ

Contrepartie	Volatilité à payer/ à recevoir	Entité de référence	Taux d'exercice de volatilité	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	À payer	Volatilité réalisée au cours USD contre JPY à 1 an[1]	12,025 %	20/06/2023	$ 320	$ 0	$ 0	$ 0	0,00

[1] Swap de variance.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	CNH	297 323	$	46 075	$ 3 048	$ 0	$ 3 048	0,16
	01/2023	€	103		110	0	0	0	0,00
	01/2023	HUF	1 205 335		3 077	0	(135)	(135)	(0,01)
	01/2023	¥	7 646 000		53 472	0	(4 523)	(4 523)	(0,24)
	01/2023	MYR	656 557		147 529	0	(1 609)	(1 609)	(0,08)
	01/2023	PEN	182 650		46 942	105	(977)	(872)	(0,05)
	01/2023	PLN	1 423		324	0	0	0	0,00
	01/2023	RON	2 756		545	0	(50)	(50)	0,00
	01/2023	$	59 989	HUF	27 145 024	12 143	0	12 143	0,64
	01/2023		253 317	MYR	1 122 954	1 931	0	1 931	0,10
	01/2023		218	PLN	965	2	0	2	0,00
	02/2023	CHF	151	$	159	0	(4)	(4)	0,00
	02/2023	€	23 212		24 735	0	(109)	(109)	(0,01)
	02/2023	NOK	2 011		203	0	(2)	(2)	0,00
	02/2023	$	46 029	CNH	297 323	0	(2 894)	(2 894)	(0,15)
	02/2023		30 034	€	28 334	292	0	292	0,02
	02/2023		2 232	ZAR	40 708	152	0	152	0,01
	03/2023	CLP	2 087 832	$	2 407	0	(21)	(21)	0,00
	03/2023	$	2 197	CLP	1 946 103	66	0	66	0,00
	03/2023		2 108	IDR	32 829 360	14	0	14	0,00
	03/2023		4 476	MXN	88 943	31	0	31	0,00
	03/2023		30 526	ZAR	539 003	969	0	969	0,05
	04/2023	PLN	69 105	€	13 725	0	(839)	(839)	(0,04)
	05/2023	€	3 205	CZK	80 981	107	0	107	0,01
	05/2023	$	2 762	ZAR	50 751	189	0	189	0,01
	03/2030		12 534	IDR	246 110 438	650	0	650	0,03
BPS	01/2023	BRL	296 178	$	56 738	641	0	641	0,03
	01/2023	HUF	3 934 842		10 122	0	(347)	(347)	(0,02)
	01/2023	ILS	22 130		6 456	181	0	181	0,01
	01/2023	MYR	454 368		102 070	0	(1 158)	(1 158)	(0,06)
	01/2023	PEN	18 435		4 771	0	(63)	(63)	0,00
	01/2023	RON	17 688		3 439	0	(375)	(375)	(0,02)
	01/2023	THB	1 387 787		40 249	121	0	121	0,01
	01/2023	$	1 857	BRL	9 838	6	0	6	0,00
	01/2023		633	CLP	555 304	19	0	19	0,00
	01/2023		45 468	CNH	297 323	0	(2 441)	(2 441)	(0,13)
	01/2023		1 834	CZK	45 940	195	0	195	0,01
	01/2023		556	HUF	211 060	5	0	5	0,00
	01/2023		124 235	MYR	558 334	3 451	0	3 451	0,18
	01/2023		17 326	PHP	963 494	16	0	16	0,00
	01/2023		2 857	PLN	13 749	276	0	276	0,01
	01/2023		156	THB	5 407	0	0	0	0,00
	02/2023	€	62 802	$	65 122	0	(2 097)	(2 097)	(0,11)
	02/2023	$	56 387	BRL	296 178	0	(596)	(596)	(0,03)
	03/2023	CLP	26 851 347	$	27 807	0	(3 372)	(3 372)	(0,18)
	03/2023	COP	16 292 726		3 467	152	0	152	0,01
	03/2023	INR	86 452		1 042	3	0	3	0,00
	03/2023	MXN	74 003		3 662	0	(84)	(84)	0,00
	03/2023	MYR	855 046		185 396	0	(10 845)	(10 845)	(0,57)
	03/2023	TWD	3 953		131	2	0	2	0,00
	03/2023	$	24 556	CNY	169 655	109	0	109	0,01
	03/2023		38 812	COP	189 180 037	29	(346)	(317)	(0,02)
	03/2023		23 182	MXN	458 485	131	(109)	22	0,00
	03/2023		9 246	PEN	35 930	115	0	115	0,01
	03/2023		40 505	THB	1 387 787	0	(163)	(163)	(0,01)
	03/2023	ZAR	15 161	$	833	0	(53)	(53)	0,00
	04/2023	CLP	5 294 110		5 697	0	(418)	(418)	(0,02)
	05/2023	€	1 122	CZK	29 415	84	0	84	0,00
	11/2023	ILS	31 394	$	9 118	41	(5)	36	0,00
BRC	01/2023	CLP	15 651 214		18 178	0	(179)	(179)	(0,01)
	01/2023	CZK	5 968		244	0	(20)	(20)	0,00
	01/2023	MYR	217 982		46 207	0	(3 653)	(3 653)	(0,19)
	01/2023	PHP	936 999		16 787	0	(79)	(79)	0,00
	01/2023	PLN	1 526		304	0	(44)	(44)	0,00
	01/2023	SGD	1 092		811	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	$	6 060	BRL	32 055	12	0	12	0,00
	01/2023		9 712	CNH	67 715	87	0	87	0,00
	01/2023		1 827	CZK	41 680	14	0	14	0,00
	01/2023		29 130	MYR	136 247	2 034	0	2 034	0,11
	01/2023		82 747	PLN	370 557	1 683	(1)	1 682	0,09
	02/2023		10 513	€	9 907	91	0	91	0,01

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	03/2023	$	18 009	CLP	15 651 214	$ 191	$ 0	$ 191	0,01
	03/2023		2 069	IDR	32 468 610	30	0	30	0,00
	03/2023		4 147	PEN	16 059	36	0	36	0,00
	09/2023	ZAR	1 341 373	$	75 949	0	(1 296)	(1 296)	(0,07)
BSH	01/2023	CLP	1 730 753		1 959	0	(71)	(71)	0,00
	02/2023		1 537 729		1 717	0	(78)	(78)	0,00
	08/2023	PEN	7 590		1 898	0	(58)	(58)	0,00
CBK	01/2023	CLP	55 044 170		63 552	0	(950)	(950)	(0,05)
	01/2023	HUF	5 334 655		13 197	0	(979)	(979)	(0,05)
	01/2023	IDR	749 069		48	0	0	0	0,00
	01/2023	PLN	14 470		3 073	0	(224)	(224)	(0,01)
	01/2023	$	5 362	BRL	28 928	117	0	117	0,01
	01/2023		37 010	CLP	35 264 834	4 351	0	4 351	0,23
	01/2023		889	HUF	363 036	75	0	75	0,00
	01/2023		50 332	PEN	196 458	1 110	0	1 110	0,06
	01/2023		5 189	PLN	24 424	376	0	376	0,02
	01/2023		8 105	THB	280 284	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	AUD	624	$	418	0	(6)	(6)	0,00
	02/2023	EGP	13 438		500	0	(2)	(2)	0,00
	02/2023	PEN	69 448		17 476	0	(664)	(664)	(0,03)
	02/2023	$	970	BRL	5 255	20	0	20	0,00
	02/2023		5 194	CLP	4 646 428	229	0	229	0,01
	02/2023		4 875	COP	23 564 304	0	(60)	(60)	0,00
	02/2023		964	EGP	27 823	76	0	76	0,00
	02/2023		12 532	€	11 707	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023		4 649	PEN	18 690	229	0	229	0,01
	03/2023	COP	14 830 279	$	3 241	224	0	224	0,01
	03/2023	ILS	24 179		7 087	200	0	200	0,01
	03/2023	PEN	5 437		1 386	0	(30)	(30)	0,00
	03/2023	TWD	290 213		9 551	39	0	39	0,00
	03/2023	$	16 099	COP	78 395 447	0	(144)	(144)	(0,01)
	03/2023		48	IDR	749 069	1	0	1	0,00
	03/2023		6 290	MXN	126 385	113	0	113	0,01
	03/2023		3 919	PEN	15 755	190	0	190	0,01
	03/2023		3 386	UYU	133 920	0	(79)	(79)	0,00
	04/2023		58 357	CLP	51 154 101	727	0	727	0,04
	04/2023		45 665	PEN	182 662	1 827	0	1 827	0,10
	05/2023	MXN	151	$	7	0	0	0	0,00
	05/2023	PEN	215 745		54 938	0	(1 053)	(1 053)	(0,05)
	07/2023	ILS	20 463		5 930	54	0	54	0,00
	07/2023	$	4 787	EGP	90 000	0	(1 647)	(1 647)	(0,09)
	11/2023	ILS	37 683	$	11 421	521	0	521	0,03
	11/2023	$	181	EGP	5 845	16	0	16	0,00
CLY	01/2023	HUF	4 897 557	$	12 448	0	(604)	(604)	(0,03)
	01/2023	MYR	100 000		21 157	0	(1 716)	(1 716)	(0,09)
	01/2023	$	59 382	MYR	280 694	4 821	0	4 821	0,25
	03/2023		4 269	PEN	16 423	9	0	9	0,00
	11/2023	€	1 739	HUF	805 467	96	0	96	0,01
DUB	01/2023	RON	8 759	$	1 748	0	(141)	(141)	(0,01)
	01/2023	TRY	73 639		3 599	0	(305)	(305)	(0,02)
	02/2023	EGP	10 906		402	0	(4)	(4)	0,00
	02/2023	€	6 655		6 951	0	(172)	(172)	(0,01)
	02/2023	ZAR	111 056		6 650	145	0	145	0,01
	03/2023	MXN	17 616		883	0	(9)	(9)	0,00
	03/2023	PEN	4 455		1 132	0	(29)	(29)	0,00
	11/2023	EGP	14 282		501	19	0	19	0,00
GLM	01/2023	BRL	328 513		62 268	216	(170)	46	0,00
	01/2023	CLP	8 704 593		9 492	0	(717)	(717)	(0,04)
	01/2023	COP	24 795 094		5 126	18	0	18	0,00
	01/2023	CZK	46 471		1 840	0	(212)	(212)	(0,01)
	01/2023	HUF	4 602 432		11 757	0	(498)	(498)	(0,03)
	01/2023	MYR	65 439		13 965	0	(1 003)	(1 003)	(0,05)
	01/2023	PLN	70 679		14 321	0	(1 782)	(1 782)	(0,09)
	01/2023	$	10 326	BRL	55 112	113	0	113	0,01
	01/2023		24 773	CLP	24 375 964	3 800	0	3 800	0,20
	01/2023		10 538	CNH	73 335	74	0	74	0,00
	01/2023		38 423	COP	186 274 890	0	(53)	(53)	0,00
	01/2023		426	CZK	9 913	12	0	12	0,00
	01/2023		46	HKD	362	0	0	0	0,00
	01/2023		2 306	HUF	894 606	71	0	71	0,00
	01/2023		29 436	MYR	137 579	2 033	0	2 033	0,11
	01/2023		1 413	PLN	6 558	81	0	81	0,00
	01/2023		1 995	RON	9 456	44	0	44	0,00
	01/2023		71 147	THB	2 479 750	555	0	555	0,03
	02/2023	COP	42 009 794	$	8 603	209	(191)	18	0,00
	02/2023	DOP	941 273		17 023	406	0	406	0,02
	02/2023	$	59 902	BRL	317 822	172	(206)	(34)	0,00
	02/2023		7 629	EGP	220 376	567	0	567	0,03
	02/2023		44 267	MXN	905 063	1 894	0	1 894	0,10
	03/2023	CLP	29 828 275	$	32 742	0	(1 943)	(1 943)	(0,10)
	03/2023	COP	272 651 216		56 277	794	0	794	0,04
	03/2023	MXN	1 018 547		49 890	0	(1 659)	(1 659)	(0,09)
	03/2023	$	10 319	COP	49 824 723	0	(180)	(180)	(0,01)
	03/2023		15 645	IDR	244 526 150	162	0	162	0,01

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	04/2023	DOP	299 685	$	5 448	$ 217	$ 0	$ 217	0,01
	04/2023	$	229	MXN	4 598	3	0	3	0,00
	05/2023		3 491	PEN	14 127	177	0	177	0,01
	05/2023	ZAR	124 117	$	7 427	210	0	210	0,01
	07/2023	EGP	188 808		7 215	657	0	657	0,03
	11/2023		14 312		501	18	0	18	0,00
	11/2023	$	747	EGP	22 633	16	0	16	0,00
HUS	07/2023	EGP	469 250	$	25 000	8 627	0	8 627	0,45
IND	06/2024	$	7 206	TWD	185 403	0	(834)	(834)	(0,04)
JPM	01/2023	£	7 576	$	9 148	34	0	34	0,00
	01/2023	HUF	5 338 049		13 515	0	(694)	(694)	(0,04)
	01/2023	PHP	1 648		30	0	0	0	0,00
	01/2023	TRY	40 626		2 108	0	(46)	(46)	0,00
	01/2023	$	97 145	BRL	512 802	27	(46)	(19)	0,00
	01/2023		19 492	CNY	135 667	157	0	157	0,01
	01/2023		6 906	IDR	108 836 219	103	0	103	0,01
	01/2023		2 771	MXN	55 232	57	0	57	0,00
	01/2023		4 493	RON	22 078	268	0	268	0,01
	01/2023		7 204	TRY	137 056	62	0	62	0,00
	02/2023	EGP	203 372	$	7 454	0	(110)	(110)	(0,01)
	02/2023	MXN	738 855		36 119	0	(1 565)	(1 565)	(0,08)
	02/2023	TWD	77 233		2 544	21	0	21	0,00
	03/2023	COP	8 107 706		1 766	116	0	116	0,01
	03/2023	IDR	108 953 618		6 906	0	(137)	(137)	(0,01)
	03/2023	MXN	17 616		882	0	(9)	(9)	0,00
	03/2023	$	10 472	CNY	72 446	60	0	60	0,00
	03/2023		27 114	IDR	424 536 831	329	0	329	0,02
	03/2023		36 119	MXN	744 652	1 568	0	1 568	0,08
	03/2023		13 242	PEN	51 368	140	0	140	0,01
	03/2023	ZAR	40 981	$	2 352	0	(43)	(43)	0,00
	06/2023	$	238	VND	5 712 000	0	0	0	0,00
	11/2023	HUF	806 200	€	1 739	0	(98)	(98)	(0,01)
	03/2030	IDR	252 540 875	$	12 118	0	(1 410)	(1 410)	(0,07)
	03/2030	$	11 598	IDR	246 110 438	1 586	0	1 586	0,08
MBC	01/2023	CLP	989 172	$	1 107	0	(53)	(53)	0,00
	01/2023	CNH	13 781		1 979	0	(15)	(15)	0,00
	01/2023	£	6 876		8 367	94	0	94	0,01
	01/2023	¥	199 600		1 473	0	(41)	(41)	0,00
	01/2023	MYR	51 983		11 089	0	(802)	(802)	(0,04)
	01/2023	THB	69 587		2 008	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	$	2 633	CNH	18 303	16	0	16	0,00
	01/2023		1 610	CZK	37 519	47	0	47	0,00
	01/2023		6 227	£	5 088	0	(106)	(106)	(0,01)
	01/2023		193	HKD	1 502	0	0	0	0,00
	01/2023		1 676	HUF	673 947	115	0	115	0,01
	01/2023		122	ILS	420	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023		1 000	¥	131 500	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023		87 680	MYR	388 835	591	0	591	0,03
	01/2023		602	PEN	2 339	10	0	10	0,00
	01/2023		40 463	PLN	205 511	6 361	0	6 361	0,33
	02/2023	CLP	2 428 917	$	2 594	0	(242)	(242)	(0,01)
	02/2023	$	3 283	EGP	94 410	248	0	248	0,01
	02/2023		3 441	MXN	67 378	0	(6)	(6)	0,00
	03/2023	IDR	32 934 383	$	2 098	0	(31)	(31)	0,00
	03/2023	MYR	27 974		5 948	0	(472)	(472)	(0,02)
	03/2023	PEN	75 862		19 666	0	(97)	(97)	(0,01)
	03/2023	THB	88 785		2 590	9	0	9	0,00
	03/2023	$	1 881	COP	9 181 424	0	(13)	(13)	0,00
	03/2023		6 163	IDR	96 058 839	46	0	46	0,00
	05/2023		9 495	CNH	63 720	0	(196)	(196)	(0,01)
	05/2023		105	ZAR	1 892	5	0	5	0,00
	09/2023	ZAR	158 510	$	8 762	0	(366)	(366)	(0,02)
MYI	01/2023	€	6		7	0	0	0	0,00
	01/2023	£	12 873		15 846	359	0	359	0,02
	01/2023	HUF	484 472		1 119	0	(168)	(168)	(0,01)
	01/2023	IDR	108 087 150		7 005	45	0	45	0,00
	01/2023	MYR	278 443		58 947	0	(4 741)	(4 741)	(0,25)
	01/2023	PLN	3 864		813	0	(68)	(68)	0,00
	01/2023	THB	4 952		143	0	0	0	0,00
	01/2023	$	4 958	CZK	122 422	449	0	449	0,02
	01/2023		18 237	£	14 837	0	(386)	(386)	(0,02)
	01/2023		7 724	HUF	3 214 237	817	0	817	0,04
	01/2023		11 046	MYR	51 983	844	0	844	0,04
	01/2023		2 363	PLN	11 524	262	0	262	0,01
	01/2023		2 245	THB	78 008	11	0	11	0,00
	01/2023		600	TRY	11 904	31	0	31	0,00
	01/2023	ZAR	90 371	$	5 273	0	(36)	(36)	0,00
	02/2023	EGP	17 848		649	0	(18)	(18)	0,00
	02/2023	TWD	142 787		4 684	19	0	19	0,00
	02/2023	$	13 279	ZAR	234 701	467	0	467	0,02
	02/2023	ZAR	155 744	$	8 930	0	(192)	(192)	(0,01)
	03/2023	COP	8 953 904		1 814	0	(8)	(8)	0,00
	03/2023	$	4 948	IDR	77 601 052	68	0	68	0,00
	03/2023		115	MXN	2 276	0	0	0	0,00

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	03/2023	$	2 694	THB	92 385	$ 0	$ (8)	$ (8)	0,00
	03/2023	ZAR	363 975	$	20 087	0	(1 180)	(1 180)	(0,06)
	04/2023	$	97 473	MXN	2 020 794	4 223	0	4 223	0,22
	05/2023	CZK	11 554	€	438	0	(36)	(36)	0,00
	07/2023	$	25 730	EGP	568 058	0	(5 939)	(5 939)	(0,31)
RBC	01/2023	PLN	1 384	$	302	0	(14)	(14)	0,00
	01/2023	$	297	HUF	120 716	24	0	24	0,00
	02/2023	MXN	77 533	$	3 911	0	(44)	(44)	0,00
	02/2023	NOK	3 066		307	0	(4)	(4)	0,00
	03/2023	$	5 780	MXN	115 957	99	0	99	0,01
	04/2023	MXN	2 071 344	$	99 926	0	(4 314)	(4 314)	(0,22)
RYL	01/2023	$	4 913	MYR	23 126	377	0	377	0,02
	02/2023	ZAR	99 971	$	5 751	0	(103)	(103)	(0,01)
SCX	01/2023	MYR	309 850		69 986	0	(354)	(354)	(0,02)
	01/2023	PEN	8 902		2 273	0	(56)	(56)	0,00
	01/2023	THB	2 401 559		69 661	220	0	220	0,01
	01/2023	$	27 572	CLP	27 007 761	4 064	0	4 064	0,21
	01/2023		460	KRW	608 180	23	0	23	0,00
	01/2023		72 307	MYR	319 998	862	0	862	0,05
	01/2023		4 795	PEN	18 402	30	0	30	0,00
	01/2023		29 513	THB	1 020 435	6	(14)	(8)	0,00
	01/2023	ZMW	35 882	$	1 989	6	0	6	0,00
	02/2023	EGP	65 327		2 424	0	(19)	(19)	0,00
	02/2023	TWD	109 820		3 569	0	(21)	(21)	0,00
	02/2023	ZAR	9 426		510	0	(42)	(42)	0,00
	03/2023	AED	28 635		7 796	0	0	0	0,00
	03/2023	CLP	7 787 406		8 917	0	(139)	(139)	(0,01)
	03/2023	IDR	305 310 835		19 509	0	(227)	(227)	(0,01)
	03/2023	$	18	CNY	126	0	0	0	0,00
	03/2023		9 862	IDR	153 912 754	87	0	87	0,00
	03/2023		71	PEN	273	0	0	0	0,00
	03/2023		70 098	THB	2 401 559	0	(287)	(287)	(0,01)
	03/2023	ZAR	118 886	$	6 420	0	(526)	(526)	(0,03)
	04/2023	KES	101 841		764	0	(54)	(54)	0,00
	05/2023	$	2 648	ZAR	46 243	41	0	41	0,00
	06/2023	CLP	23 031	$	25	0	(2)	(2)	0,00
	03/2030	IDR	239 680 000		10 700	0	(2 140)	(2 140)	(0,11)
SOG	01/2023	RON	27 923		5 497	0	(524)	(524)	(0,03)
	03/2023	CLP	1 835 492		2 063	0	(71)	(71)	0,00
	03/2023	KES	79 902		617	0	(25)	(25)	0,00
	05/2023	CZK	19 582	€	752	0	(51)	(51)	0,00
	05/2023	$	1 383	ZAR	25 231	84	0	84	0,00
SSB	01/2023	COP	161 479 796	$	31 497	0	(1 765)	(1 765)	(0,09)
	01/2023	$	11 050	MYR	51 983	841	0	841	0,04
TOR	01/2023		1 846	PEN	7 306	66	0	66	0,00
	02/2023		3 602	ZAR	65 637	243	0	243	0,01
UAG	01/2023	BRL	14 044	$	2 617	0	(43)	(43)	0,00
	01/2023	CLP	5 298 881		5 938	0	(277)	(277)	(0,01)
	01/2023	CZK	74 918		3 285	0	(24)	(24)	0,00
	01/2023	HUF	8 165 269		20 775	0	(983)	(983)	(0,05)
	01/2023	RON	44 384		9 501	0	(70)	(70)	0,00
	01/2023	TRY	214 957		10 607	0	(768)	(768)	(0,04)
	01/2023	$	32 420	CZK	824 499	3 991	0	3 991	0,21
	01/2023		8 995	£	7 265	0	(255)	(255)	(0,01)
	01/2023		2 858	HUF	1 127 600	139	0	139	0,01
	01/2023		10 855	TRY	205 287	6	0	6	0,00
	01/2023		5 652	TWD	146 785	0	(870)	(870)	(0,05)
	02/2023	CNH	297 323	$	46 242	3 107	0	3 107	0,16
	02/2023	€	347		362	0	(10)	(10)	0,00
	02/2023	$	1 887	ZAR	35 151	172	0	172	0,01
	02/2023	ZAR	2 619	$	154	1	0	1	0,00
	03/2023	$	3 934	MXN	78 179	27	0	27	0,00
	05/2023	€	1 928	CZK	48 788	67	0	67	0,00
	09/2023	$	7 246	ZAR	128 361	146	0	146	0,01
	11/2023	ILS	6 376	$	1 844	0	(1)	(1)	0,00
						$ 100 579	$ (90 871)	$ 9 708	0,52
Total des Instruments financiers dérivés hors cote								**$ 21 104**	**1,10**

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CERTIFICATS DE DÉPÔT					
Bancolombia S.A.					
2,860 % éch. 25/02/2024	COP	4 650 000	$	895	0,05
8,711 % éch. 04/04/2023		14 801 400		3 012	0,16
12,021 % éch. 04/08/2023		10 966 000		2 217	0,11
14,763 % éch. 12/05/2023		4 523 900		930	0,05
Total des Certificats de dépôt			**$**	**7 054**	**0,37**
Total des Investissements			**$**	**1 913 724**	**99,69**
Autres actifs et passifs à court terme			**$**	**5 944**	**0,31**
Actif net			**$**	**1 919 668**	**100,00**

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(d) Titre à coupon zéro.

(e) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(f) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

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

(h) Affilié au Fonds.

(i) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 2,03 %) :

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Constellation Oil Services Holding S.A. « B »	06/10/2022	$ 41	$ 41	0,00
Banque de développement d'Afrique du Sud 8,600 % échéance 21/10/2024	07/10/2021	14 861	12 807	0,67
Flourish Century 6,600 % échéance 04/02/2049	25/08/2021	2 759	311	0,02
JPMorgan Structured Products BV 3,660 % échéance 04/01/2027	15/06/2021	899	1 223	0,07
		$ 18 560	$ 14 382	0,76

(j) Des titres d'une juste valeur globale de 86 429 $ (31 décembre 2021 : 404 051 $) et un montant en numéraire de 1 840 $ (31 décembre 2021 : 6 127 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 0 $ (31 décembre 2021 : 968 $) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 21 557 $ (31 décembre 2021 : 22 709 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 28 320 $ (31 décembre 2021 : 13 610 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 1 695 287	$ 77 697	$ 1 772 984
Fonds d'investissement	131 643	0	0	131 643
Instruments financiers dérivés[3]	739	1 315	(11)	2 043
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	3 012	4 042	7 054
Totaux	**$ 132 382**	**$ 1 699 614**	**$ 81 728**	**$ 1 913 724**

Voici une synthèse des données significatives non observables utilisées dans les évaluations à la juste valeur des actifs et passifs classés au niveau 3 de la hiérarchie de la juste valeur :

Catégorie et sous-catégorie	Juste valeur au 31 décembre 2022	Technique d'évaluation	Données non observables	Valeur(s) des données (% sauf indication contraire)
Valeurs mobilières				
Actions ordinaires	$ 0	Autres techniques d'évaluation	Cotation du courtier	$ 0.01
	41	Multiple comparable	EBITDA	$ 4,40
Obligations et billets privés	311	Reprise attendue	Taux d'actualisation	$ 0,00–20,00
	36	Reprise attendue	Prix de base	MXN 0,00
	16 697	Flux de trésorerie actualisé	Taux d'actualisation	BRL 0,00-9,76
	40 534	Autres techniques d'évaluation	Prix de base	$ 98,93-101,85
Crédits consortiaux et cessions	7 248	Cotation de marché indicative	Cotation du courtier	$ 95,00
Émissions souveraines	31	Reprise attendue	Prix de base	€ 29,00
	396	Reprise attendue	Prix de base	$ 33,00
	4 624	Reprise attendue	Prix de base	RUB 31,00
	7 779	Vendeur tiers	Cotation du courtier	$ 99,00
Swaps de défaillance - vente de protection	(11)	Cotation de marché indicative	Cotation du courtier	$ (1,36)
Dépôts auprès d'établissements de crédit	4 042	Tarification par procuration	Prix de base	$ 95,90-99,56
Totaux	**$ 81 728**			

Le tableau suivant montre la sensibilité de l'évolution de la juste valeur des investissements dans des titres classés au niveau 3 à une variation raisonnablement possible de la valeur de marché, si le marché progresse ou baisse de 10 %, en supposant que toutes les autres variables restent constantes :

	31 décembre 2022
Catégorie et sous-catégorie	Sensibilité de l'évolution de la juste valeur des investissements Augmentation/(diminution)
Valeurs mobilières	
Actions ordinaires	$ 4
Obligations et billets privés	5 758
Crédits consortiaux et cessions	1 503
Émissions souveraines	505
Swaps de défaillance - vente de protection	(1)
Dépôts auprès d'établissements de crédit	404
Totaux	**$ 8 173**

Report de Niveau 3	31 décembre 2022
Juste valeur au début de l'exercice	$ 260 903
Achats au cours de l'exercice	13 610
Ventes au cours de l'exercice	(157 479)
Entrées	4 934
Sorties	(17 119)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée	(13 437)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente	(9 684)
Juste valeur à la fin de l'exercice	**$ 81 728**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 2 063 357	$ 260 952	$ 2 324 309
Fonds d'investissement	171 278	0	0	171 278
Contrats de mise en pension	0	591	0	591
Instruments financiers dérivés[3]	0	26 571	(49)	26 522
Totaux	**$ 171 278**	**$ 2 090 519**	**$ 260 903**	**$ 2 522 700**

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

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

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

Voici une synthèse des données significatives non observables utilisées dans les évaluations à la juste valeur des actifs et passifs classés au niveau 3 de la hiérarchie de la juste valeur :

Catégorie et sous-catégorie	Juste valeur au 31 décembre 2021	Technique d'évaluation	Données non observables	Valeur(s) des données (% sauf indication contraire)
Valeurs mobilières				
Actions ordinaires				0,00
	$ 0	Cotation de marché indicative	Cotation du courtier	$
Obligations et billets privés	17 225	Cotation de marché indicative	Cotation du courtier	$ 6,25-74,36
	8 338	Instrument de référence	Moyenne pondérée	BRL 50,47
	215 282	Instrument de référence	Rendement	5,52-6,66
	34	Tarification par procuration	Prix de base	$ 0,15
	—	Tarification par procuration	Prix de base	$ 0,00
Crédits consortiaux et cessions	20 073	Cotation de marché indicative	Cotation du courtier	$ 112,01-113,72
Swaps de défaillance - vente de protection	(49)	Cotation de marché indicative	Cotation du courtier	$ (0,44)-(5,24)
Totaux	**$ 260 903**			

Le tableau suivant montre la sensibilité de l'évolution de la juste valeur des investissements dans des titres classés au niveau 3 à une variation raisonnablement possible de la valeur de marché, si le marché progresse ou baisse de 10 %, en supposant que toutes les autres variables restent constantes :

Catégorie et sous-catégorie	31 décembre 2021 Sensibilité de l'évolution de la juste valeur des investissements Augmentation/(diminution)
Valeurs mobilières	
Actions ordinaires	$ 0
Obligations et billets privés	24 088
Crédits consortiaux et cessions	2 007
Swaps de défaillance - vente de protection	(5)
Totaux	**$ 26 090**

Report de Niveau 3	31 décembre 2021
Juste valeur au début de l'exercice	$ 289 170
Achats au cours de l'exercice	57 544
Ventes au cours de l'exercice	(23 163)
Entrées	—
Sorties	(38 524)
Plus-value/(moins-value) nette réalisée	(1 013)
Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente	(23 111)
Juste valeur à la fin de l'exercice	**$ 260 903**

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance		Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	En % de l'actif net
BPS	7,000 %	12/12/2022	TBD (1)	PLN	(88 241)	$ (20 198)	(1,05)
	8,400	12/12/2022	08/12/2024		(82 688)	(18 934)	(0,99)
	7,000	12/12/2022	TBD (1)	PLN	(197 832)	(45 279)	(2,36)
BRC	7,500	12/12/2022	TBD (1)	ZAR	(15 306)	(902)	(0,05)
Total des Contrats de prise en pension						**$ (85 313)**	**(4,45)**

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ 13 050	$ (12 520)	$ 530	$ 2 550	$ (1 970)	$ 580
BPS	(16 890)	15 580	(1 310)	10 355	(10 190)	165
BRC	(1 554)	1 440	(114)	1 066	(1 080)	(14)
BSH	(1 101)	0	(1 101)	(247)	0	(247)
BSS	0	920	920	217	0	217
CBK	6 571	(6 325)	246	(9 214)	9 960	746
CKL	(265)	0	(265)	387	0	387
CLY	2 606	0	2 606	S/O	S/O	S/O
DUB	50	0	50	(55)	1 100	1 045
GLM	10 551	(10 070)	481	12 692	(11 150)	1 542
GST	(180)	190	10	S/O	S/O	S/O
HUS	6 780	(6 910)	(130)	852	(1 360)	(508)
IND	(834)	(1 510)	(2 344)	(342)	360	18
JPM	1 710	(1 280)	430	11 239	(11 570)	(331)
MBC	5 248	(4 930)	318	S/O	S/O	S/O
MYC	(365)	410	45	(1)	(294)	(295)
MYI	(4 865)	3 730	(1 135)	2 801	(3 190)	(389)
RBC	(4 253)	4 420	167	47	0	47
RYL	274	(260)	14	464	(280)	184
SCX	1 418	(1 120)	298	(1 236)	790	(446)
SOG	(587)	590	3	585	(390)	195
SSB	(924)	1 040	116	(1 012)	930	(82)
TOR	309	(270)	39	(340)	460	120
UAG	4 355	(4 700)	(345)	4 605	(4 570)	35

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	63,67	73,96
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	27,35	32,81
Autres valeurs mobilières	1,33	1,27
Fonds d'investissement	6,86	7,96
Contrats de mise en pension	S/O	0,03
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,04	S/O
Instruments financiers dérivés compensés	(1,03)	(0,41)
Instruments financiers dérivés hors cote	1,10	1,65
Certificats de dépôt	0,37	S/O
Contrats de prise en pension	(4,45)	(17,42)

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Argentine	0,16	0,20
Azerbaïdjan	0,23	S/O
Bahamas	0,13	S/O
Brésil	4,48	4,08
Îles Caïmans	0,44	0,50
Chili	2,06	4,74
Chine	5,74	14,54
Colombie	3,65	6,44
République tchèque	2,89	2,23
Danemark	0,00	0,23
République dominicaine	1,30	0,87
Égypte	S/O	2,32
France	S/O	1,37
Allemagne	S/O	2,23
Hongrie	0,40	1,08
Inde	S/O	0,25
Indonésie	5,26	1,44
Irlande	0,83	1,49
Israël	1,75	0,47
Italie	S/O	0,29
Côte d'Ivoire	0,38	0,42
Jersey, Iles Anglo-Normandes	0,51	S/O
Kazakhstan	0,05	0,26
Luxembourg	0,01	0,01
Malaisie	9,11	8,39
Mexique	8,11	3,56
Pays-Bas	0,20	0,35
Nigeria	0,22	0,24

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Pérou	2,32	3,41
Philippines	0,04	0,90
Pologne	4,79	1,81
Qatar	0,92	5,22
Roumanie	3,99	3,08
Russie	0,26	5,87
Serbie	0,15	0,33
Singapour	S/O	1,63
Afrique du Sud	13,70	12,47
Corée du Sud	0,18	0,02
Espagne	S/O	0,03
Supranationales	0,37	0,47
Suisse	S/O	0,26
Tanzanie	0,49	0,64
Thaïlande	4,23	5,88
Turquie	0,53	1,33
Ukraine	S/O	0,22
Émirats arabes unis	1,60	1,25
Royaume-Uni	0,58	0,27
États-Unis	2,50	3,93
Îles Vierges britanniques	0,31	S/O
Zambie	S/O	0,16
Instruments à court terme	7,48	0,86
Fonds d'investissement	6,86	7,96
Contrats de mise en pension	S/O	0,03
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,04	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	S/O	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(1,03)	(0,41)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Options de change	0,13	0,10
Options vendues		
Options de change	(0,01)	(0,01)
Swaptions de taux d'intérêt	(0,01)	S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	S/O	0,02
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,14)	(0,01)
Swaps sur devises croisées	0,42	0,33
Swaps de taux d'intérêt	0,19	0,30
Swaps de volatilité	0,00	0,01
Contrats de change à terme	0,52	0,91
Certificats de dépôt	0,37	S/O
Autres actifs et passifs à court terme	0,31	(17,27)
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Emerging Local Bond ESG Fund

31 décembre 2022

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
CHILI				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos				
2,800 % éch. 01/10/2033	CLP	45 000	$ 43	0,65
4,700 % éch. 01/09/2030		20 000	23	0,34
5,000 % éch. 01/10/2028		60 000	68	1,03
			134	**2,02**
COLOMBIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
TES colombien				
7,000 % éch. 26/03/2031	COP	1 603 200	234	3,54
RÉPUBLIQUE TCHÈQUE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de République tchèque				
0,050 % éch. 29/11/2029	CZK	3 400	107	1,62
0,250 % éch. 10/02/2027		1 300	47	0,71
2,000 % éch. 13/10/2033		2 300	77	1,17
2,400 % éch. 17/09/2025		4 800	197	2,98
4,200 % éch. 04/12/2036		600	24	0,36
			452	**6,84**
RÉPUBLIQUE DOMINICAINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Billets de la Banque centrale de la République dominicaine				
12,000 % éch. 03/10/2025	DOP	900	15	0,23
ALLEMAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				
0,625 % éch. 25/07/2025	PLN	500	96	1,45
HONGRIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement hongrois				
4,000 % éch. 28/04/2051	HUF	15 900	22	0,33
4,500 % éch. 27/05/2032		46 600	89	1,35
5,000 % éch. 22/02/2027	€	30	32	0,49
			143	**2,17**
INDONÉSIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement indonésien				
6,375 % éch. 15/04/2042	IDR	1 175 000	68	1,03
7,000 % éch. 15/02/2033		796 000	51	0,77
7,125 % éch. 15/06/2042		17 000	1	0,02
8,250 % éch. 15/05/2036		1 335 000	94	1,42
8,375 % éch. 15/03/2034		554 000	39	0,59
8,750 % éch. 15/05/2031		1 386 000	99	1,50
			352	**5,33**
ISRAËL				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement israélien				
0,150 % éch. 31/07/2023	ILS	500	139	2,10
1,500 % éch. 30/11/2023		100	28	0,42
			167	**2,52**
MALAISIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement malaisien				
2,632 % éch. 15/04/2031	MYR	200	$ 41	0,62
3,582 % éch. 15/07/2032		320	70	1,06
3,757 % éch. 22/05/2040		200	42	0,64
4,696 % éch. 15/10/2042		134	32	0,48
Émission d'investissement du gouvernement malaisien				
3,990 % éch. 15/10/2025		208	47	0,71
4,130 % éch. 09/07/2029		850	194	2,94
4,369 % éch. 31/10/2028		610	141	2,13
			567	**8,58**
MEXIQUE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement mexicain				
7,500 % éch. 03/06/2027	MXN	3 400	164	2,48
7,750 % éch. 29/05/2031		1 300	62	0,94
8,000 % éch. 07/11/2047		429	20	0,30
8,500 % éch. 18/11/2038		2 100	102	1,54
			348	**5,26**
PÉROU				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement péruvien				
6,350 % éch. 12/08/2028	PEN	300	75	1,13
6,900 % éch. 12/08/2037		300	71	1,07
			146	**2,20**
POLOGNE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement polonais				
1,250 % éch. 25/10/2030	PLN	59	9	0,14
1,750 % éch. 25/04/2032		250	37	0,56
2,500 % éch. 25/07/2026		500	99	1,50
2,750 % éch. 25/10/2029		100	18	0,27
			163	**2,47**
ROUMANIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement roumain				
3,250 % éch. 29/04/2024	RON	800	165	2,50
4,150 % éch. 26/01/2028		300	55	0,83
4,150 % éch. 24/10/2030		200	34	0,52
4,250 % éch. 28/04/2036		200	29	0,44
4,750 % éch. 11/10/2034		40	6	0,09
			289	**4,38**
AFRIQUE DU SUD				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement sud-africain				
2,000 % éch. 31/01/2025 (c)	ZAR	509	29	0,44
6,500 % éch. 28/02/2041		3 000	111	1,68
8,000 % éch. 31/01/2030		1 000	53	0,80
8,250 % éch. 31/03/2032		1 700	85	1,28
8,500 % éch. 31/01/2037		500	23	0,35
8,750 % éch. 28/02/2048		3 900	179	2,71
10,500 % éch. 21/12/2026		3 600	224	3,39
			704	**10,65**
SUPRANATIONALES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banque de développement asiatique				
4,700 % éch. 12/03/2024	MXN	2 200	$ 104	1,57
6,000 % éch. 05/02/2026	BRL	750	123	1,86
Banque européenne pour la reconstruction et le développement				
3,010 % éch. 13/03/2028	PLN	600	110	1,67
5,080 % éch. 15/12/2025	MXN	1 900	85	1,29
Banque interaméricaine de développement				
5,500 % éch. 07/02/2023	IDR	2 110 000	136	2,06
Banque internationale pour la reconstruction et le développement				
4,500 % éch. 22/01/2026	ZAR	2 200	118	1,79
4,750 % éch. 21/01/2027	IDR	2 880 000	174	2,63
9,750 % éch. 21/01/2027	BRL	750	135	2,04
			985	**14,91**
THAÏLANDE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais				
1,585 % éch. 17/12/2035	THB	3 726	92	1,39
2,000 % éch. 17/06/2042		180	4	0,06
3,350 % éch. 17/06/2033		808	25	0,38
3,390 % éch. 17/06/2037		3 900	117	1,77
3,450 % éch. 17/06/2043		1 520	45	0,68
			283	**4,28**
URUGUAY				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement uruguayen				
8,500 % éch. 15/03/2028	UYU	3 200	74	1,12
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BONS DU TRÉSOR HONGROIS				
18,250 % éch. 03/01/2023 (a)(b)	HUF	56 000	149	2,26
BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN				
0,529 % éch. 08/02/2023 (a)(b)	ILS	500	141	2,14
1,727 % éch. 05/07/2023 (a)(b)		200	56	0,85
1,734 % éch. 05/07/2023 (a)(b)		200	56	0,85
1,828 % éch. 02/08/2023 (a)(b)		200	55	0,83
1,837 % éch. 02/08/2023 (a)(b)		300	83	1,26
			391	**5,93**
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS				
(0,201) % éch. 16/01/2023 (a)(b)	¥	9 000	68	1,03
(0,200) % éch. 25/01/2023 (a)(b)		10 000	76	1,15
(0,190) % éch. 16/01/2023 (a)(b)		5 000	38	0,57
			182	**2,75**
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
4,397 % éch. 23/03/2023 (a)(b)	$	400	396	5,99
Total des Instruments à court terme			1 118	16,93
Total des Valeurs mobilières			**$ 6 270**	**94,88**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,445 %	02/01/2025	BRL 300	$ 1	0,02
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,515	02/01/2025	400	2	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	11,725	02/01/2025	1 500	(5)	(0,07)

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

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel		Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	CDI BRL à 1 an	11,734 %	02/01/2025	BRL	200	$ (1)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,740	02/01/2025		100	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,750	02/01/2025		100	0	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,800	02/01/2025		300	(1)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,835	02/01/2025		300	(1)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,845	02/01/2025		600	(1)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,870	02/01/2025		500	(1)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,005	02/01/2025		500	(1)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,210	02/01/2025		300	(1)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,740	02/01/2025		300	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,765	02/01/2025		100	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,190	02/01/2025		200	0	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,215	02/01/2025		100	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,400	02/01/2025		400	(1)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	13,800	02/01/2024		3 400	3	0,04
À payer	CDI BRL à 1 an	13,995	02/01/2024		900	1	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,400	21/11/2029	COP	18 300	0	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,820	02/12/2025		70 900	0	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,950	19/12/2024		4 300	0	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,353	15/11/2027		169 100	2	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	12,000	26/11/2025		1 148 000	(9)	(0,13)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	12,060	09/11/2025		378 000	4	0,04
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	12,070	26/11/2025		128 000	(1)	(0,01)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,740	17/08/2027	ZAR	400	0	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,590	15/11/2032	CLP	10 400	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,600	12/12/2027		13 000	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,635	12/12/2027		28 000	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,640	21/11/2032		32 000	1	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,770	21/11/2027		28 300	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,460	03/11/2032		13 400	1	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,500	12/12/2025		20 000	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,567	12/12/2025		9 000	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,160	01/10/2028		3 800	0	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,195	01/10/2028		2 100	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,390	15/11/2024		44 400	0	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,550	21/11/2024		145 500	1	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,815	04/10/2027		32 600	(4)	(0,05)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	9,135	01/03/2025		22 000	1	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	9,155	27/10/2024		14 800	0	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	9,270	01/03/2025		17 000	1	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	9,350	01/03/2025		4 900	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	9,370	01/03/2025		5 000	0	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,138	14/11/2027	CZK	700	0	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,180	14/11/2027		1 300	0	(0,01)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,600	11/11/2027		1 300	1	0,01
À payer	BBR HUF à 6 mois	9,240	02/09/2032	HUF	5 200	0	(0,01)
À payer	BBR HUF à 6 mois	10,570	22/08/2027		9 800	(1)	(0,01)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,870	22/04/2027	PLN	200	3	0,03
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,830	19/08/2024		100	0	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,890	22/08/2024		300	0	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,225	28/07/2027	MXN	1 100	1	0,02
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,414	14/12/2027		1 500	1	0,02
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,465	16/08/2027		100	0	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,515	17/12/2027		700	1	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,700	05/11/2027		100	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,743	05/11/2027		600	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,750	30/08/2027		700	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,760	05/11/2027		400	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,773	05/11/2027		500	0	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,850	31/07/2024		400	0	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,975	13/08/2024		6 900	1	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,045	04/11/2027		200	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,053	04/11/2027		200	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,117	04/11/2027		900	1	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,600	21/09/2027		300	0	0,01
						$ (1)	(0,02)
Total des Instruments financiers dérivés compensés						**$ (1)**	**(0,02)**

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

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

OPTIONS ACHETÉES

OPTIONS DE CHANGE

Contrepartie	Description	Prix d'exercice		Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - EUR contre CZK hors cote	CZK	23,830	01/11/2023	12	$ 1	$ 2	0,03
GLM	Option de vente - EUR contre HUF hors cote	HUF	385,000	01/11/2023	3	0	1	0,01
	Option de vente - EUR contre PLN hors cote	PLN	4,560	01/11/2023	12	1	2	0,03

Contrepartie	Description	Prix d'exercice		Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
MYI	Option de vente - USD contre BRL hors cote	BRL	4,450	04/05/2023	7	$ 1	$ 0	0,00
	Option de vente - USD contre ZAR hors cote	ZAR	15,925	04/05/2023	7	1	1	0,02
						$ 4	$ 6	0,09

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE CHANGE

Contrepartie	Description	Prix d'exercice		Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
MYI	Option d'achat - USD contre MXN hors cote	MXN	20,500	28/02/2023	65	$ (1)	$ 0	0,00

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
CBK	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000 %	20/12/2024	$ 100	$ (11)	$ 5	$ (6)	(0,09)

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

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

SWAPS DE VOLATILITÉ

Contrepartie	Volatilité à payer/ à recevoir	Entité de référence	Taux d'exercice de volatilité	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	À payer	Volatilité réalisée au cours USD contre JPY à 1 an[1]	12,025 %	20/06/2023	$ 1	$ 0	$ 0	$ 0	0,00

(1) Swap de variance

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	HUF	35 460	$	91	$ 0	$ (4)	$ (4)	(0,06)
	01/2023	¥	30 000		223	0	(5)	(5)	(0,07)
	01/2023	MYR	4 906		1 108	0	(6)	(6)	(0,09)
	01/2023	TRY	633		32	0	(2)	(2)	(0,03)
	01/2023	$	11	BRL	57	0	0	0	0,00
	01/2023		148	HUF	66 794	31	0	31	0,44
	01/2023		2 079	MYR	9 213	18	0	18	0,26
	01/2023	ZAR	1 219	$	69	0	(3)	(3)	(0,04)
	02/2023	€	85		90	0	0	0	(0,01)
	02/2023	$	13	EGP	288	0	(2)	(2)	(0,03)
	02/2023		105	€	99	1	0	1	0,02
	02/2023		33	£	27	0	(1)	(1)	(0,01)
	03/2023	MYR	2 839	$	626	0	(26)	(26)	(0,38)
	03/2023	THB	241		7	0	0	0	0,00
	03/2023	$	27	MXN	541	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	HUF	487	$	1	0	0	0	0,00
	01/2023	MYR	509		116	0	0	0	0,00
	01/2023	RON	244		50	0	(3)	(3)	(0,04)
	01/2023	$	21	BRL	109	0	0	0	0,00
	01/2023		81	HUF	33 771	9	0	9	0,14
	01/2023		147	¥	20 000	5	0	5	0,08
	01/2023		179	MYR	840	13	0	13	0,20
	01/2023		3	PHP	152	0	0	0	0,00
	01/2023		91	RON	446	5	0	5	0,08
	01/2023		54	SGD	72	0	0	0	0,00
	01/2023		248	THB	8 635	2	0	2	0,02
	01/2023		15	ZAR	265	1	0	1	0,02
	02/2023	£	50	$	62	1	0	1	0,02
	02/2023	$	36	€	34	0	0	0	0,00
	03/2023	COP	164 446	$	33	0	0	0	0,00
	03/2023	IDR	450 672		29	0	0	0	(0,01)
	03/2023	$	41	IDR	639 013	0	0	0	0,01
CBK	01/2023	COP	265 661	$	55	1	0	1	0,01
	01/2023	HUF	13 496		34	0	(2)	(2)	(0,03)
	01/2023	PEN	49		12	0	0	0	(0,01)
	01/2023	PLN	33		7	0	(1)	(1)	(0,01)
	01/2023	TRY	112		6	0	0	0	0,00

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

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	01/2023	$	201	BRL	1 052	$ 0	$ (1)	$ (1)	(0,02)
	01/2023		31	COP	149 060	0	0	0	0,00
	01/2023		39	CZK	984	5	0	5	0,07
	01/2023		7	PLN	33	0	0	0	0,00
	01/2023		1	THB	45	0	0	0	0,00
	01/2023		46	TRY	891	1	0	1	0,02
	02/2023	BRL	31	$	6	0	0	0	0,00
	02/2023	EGP	60		2	0	0	0	0,00
	02/2023	£	27		33	0	0	0	0,01
	02/2023	ILS	497		145	4	0	4	0,05
	02/2023	$	12	EGP	335	1	0	1	0,01
	02/2023		14	€	13	0	0	0	0,00
	02/2023		93	£	76	0	(2)	(2)	(0,03)
	02/2023		9	PEN	35	0	0	0	0,01
	03/2023	COP	546 480	$	109	0	(3)	(3)	(0,04)
	03/2023	MXN	3 068		154	0	(1)	(1)	(0,02)
	03/2023	TWD	980		32	0	0	0	0,00
	03/2023	$	156	COP	766 163	1	(1)	0	0,00
	03/2023		9	MXN	175	0	0	0	0,00
	03/2023		1	TWD	42	0	0	0	0,00
	03/2023	UYU	2 136	$	54	1	0	1	0,02
	05/2023	$	256	MXN	5 182	3	0	3	0,05
	07/2023	ILS	688	$	209	11	0	11	0,17
	08/2023		491		152	11	0	11	0,17
	08/2023	PEN	6		1	0	0	0	0,00
	11/2023	ILS	98		29	1	0	1	0,01
	11/2023	$	35	EGP	1 145	3	0	3	0,05
GLM	01/2023	BRL	1 972	$	370	0	(3)	(3)	(0,05)
	01/2023	COP	546 360		113	0	0	0	0,01
	01/2023	CZK	2 490		101	0	(9)	(9)	(0,13)
	01/2023	HUF	21 993		56	0	(2)	(2)	(0,03)
	01/2023	MYR	383		84	0	(4)	(4)	(0,05)
	01/2023	PLN	575		119	0	(13)	(13)	(0,18)
	01/2023	RON	103		21	0	(1)	(1)	(0,02)
	01/2023	$	140	BRL	753	3	0	3	0,04
	01/2023		137	COP	662 962	0	0	0	0,00
	01/2023		219	MYR	1 031	18	0	18	0,25
	01/2023		27	PEN	109	2	0	2	0,02
	01/2023		160	PLN	810	26	0	26	0,38
	01/2023		11	ZAR	189	0	0	0	0,00
	02/2023	EGP	292	$	11	0	0	0	0,00
	02/2023	MXN	150		7	0	0	0	0,00
	02/2023	$	11	BRL	57	0	0	0	0,00
	02/2023		7	COP	29 966	0	0	0	(0,01)
	03/2023	COP	662 962	$	135	0	0	0	0,00
	03/2023	MXN	1 555		76	0	(3)	(3)	(0,04)
	03/2023	$	73	CLP	66 408	4	0	4	0,06
	03/2023		49	MXN	970	0	0	0	0,00
	04/2023	DOP	869	$	16	1	0	1	0,01
	04/2023	$	353	BRL	1 914	3	0	3	0,05
	05/2023		25	PEN	100	1	0	1	0,01
	07/2023	ILS	196	$	58	2	0	2	0,03
	11/2023	EGP	1 242		43	2	0	2	0,02
	11/2023	$	2	EGP	75	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	HUF	35 396	$	86	0	(8)	(8)	(0,12)
	01/2023	IDR	354 890		23	0	0	0	0,00
	01/2023	MYR	1 473		313	0	(25)	(25)	(0,36)
	01/2023	PEN	105		26	0	(1)	(1)	(0,02)
	01/2023	PLN	22		4	0	(1)	(1)	(0,01)
	01/2023	RON	139		28	0	(2)	(2)	(0,03)
	01/2023	$	179	CZK	4 401	16	0	16	0,24
	01/2023		3	HUF	1 393	0	0	0	0,00
	01/2023		23	IDR	357 474	0	0	0	0,01
	01/2023		105	MYR	494	8	0	8	0,12
	01/2023		27	PEN	109	2	0	2	0,02
	01/2023		108	PLN	523	11	0	11	0,16
	01/2023		10	ZAR	184	1	0	1	0,01
	02/2023	EGP	275	$	10	0	0	0	0,00
	02/2023	€	30		31	0	(1)	(1)	(0,01)
	02/2023	$	33	€	31	0	0	0	0,00
	02/2023		119	TWD	3 621	0	0	0	(0,01)
	02/2023	ZAR	315	$	18	0	(1)	(1)	(0,01)
	03/2023	CLP	19 781		23	0	0	0	0,00
	03/2023	COP	49 360		10	0	0	0	0,00
	03/2023	IDR	990 047		63	0	(1)	(1)	(0,02)
	03/2023	MXN	153		8	0	0	0	0,00
	03/2023	$	108	COP	528 223	1	(2)	(1)	(0,01)
	03/2023		7	TWD	211	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	¥	14 000	$	98	0	(9)	(9)	(0,13)
	01/2023	MYR	1 471		332	0	(2)	(2)	(0,03)
	01/2023	PEN	181		45	0	(2)	(2)	(0,04)
	01/2023	RON	31		7	0	0	0	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	01/2023	THB	12 144	$	352	$ 1	$ 0	$ 1	0,02
	01/2023	TRY	1 363		67	0	(5)	(5)	(0,07)
	01/2023	$	347	MYR	1 535	4	0	4	0,06
	01/2023		100	THB	3 464	0	0	0	0,00
	01/2023		44	TRY	832	0	0	0	0,00
	02/2023	ZAR	2 589	$	144	0	(8)	(8)	(0,12)
	03/2023	MYR	825		179	0	(12)	(12)	(0,16)
	03/2023	$	55	IDR	862 688	1	0	1	0,01
	03/2023		354	THB	12 144	0	(1)	(1)	(0,02)
	04/2023	ZAR	440	$	24	0	(2)	(2)	(0,03)
						$ 236	$ (181)	$ 55	0,83
Total des Instruments financiers dérivés hors cote								**$ 55**	**0,83**

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CERTIFICATS DE DÉPÔT				
Bancolombia S.A.				
2,860 % éch. 25/02/2024	COP	20 000	$ 4	0,06
Total des Certificats de dépôt			**$ 4**	**0,06**
Total des Investissements			**$ 6 328**	**95,75**
Autres actifs et passifs à court terme			**$ 281**	**4,25**
Actif net			**$ 6 609**	**100,00**

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

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

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(c) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

Un montant en numéraire de 39 $ a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 6 270	$ 0	$ 6 270
Instruments financiers dérivés[3]	0	54	0	54
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	4	4
Totaux	**$ 0**	**$ 6 324**	**$ 4**	**$ 6 328**

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

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

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ 3	$ 0	$ 3
BRC	33	0	33
CBK	26	0	26
GLM	30	0	30
MYI	(2)	0	(2)
SCX	(35)	0	(35)

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)[1]
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	69,10	S/O
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	24,21	S/O
Autres valeurs mobilières	1,57	S/O
Instruments financiers dérivés compensés	(0,02)	S/O
Instruments financiers dérivés hors cote	0,83	S/O
Certificats de dépôt	0,06	S/O

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

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
ALBANIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement albanais				
3,500 % éch. 23/11/2031	€	3 500	$ 3 046	0,09
ANGOLA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement angolais				
8,250 % éch. 09/05/2028	$	6 200	5 670	0,17
8,750 % éch. 14/04/2032		300	261	0,01
9,500 % éch. 12/11/2025		400	413	0,01
Total Angola			6 344	0,19
ARGENTINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement argentin				
0,500 % éch. 09/07/2030		23 400	6 388	0,19
1,000 % éch. 09/07/2029		13 237	3 541	0,11
1,500 % éch. 09/07/2035		27 167	6 914	0,21
3,500 % éch. 09/07/2041		35 855	10 282	0,31
3,875 % éch. 09/01/2038		36 056	11 480	0,35
Provincia de Buenos Aires				
5,250 % éch. 01/09/2037		5 000	1 747	0,05
Provincia de Cordoba				
6,875 % éch. 10/12/2025 ^		2 290	1 858	0,06
Provincia de Entre Rios Argentina				
5,750 % éch. 08/08/2028 ^		2 372	1 557	0,05
Provincia de la Rioja				
4,750 % éch. 24/02/2028 ^		6 321	3 034	0,09
Provincia de Neuquen				
6,625 % éch. 27/04/2030 ^		2 210	1 516	0,04
Total Argentine			48 317	1,46
AZERBAÏDJAN				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC				
7,230 % éch. 17/03/2026		12 500	12 219	0,37
Southern Gas Corridor CJSC				
6,875 % éch. 24/03/2026		28 700	29 512	0,89
State Oil Co. of the Azerbaijan Republic				
4,750 % éch. 13/03/2023		700	697	0,02
			42 428	**1,28**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement azerbaïdjanais				
4,750 % éch. 18/03/2024		908	902	0,03
Total Azerbaïdjan			43 330	1,31
BAHAMAS				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement des Bahamas				
6,000 % éch. 21/11/2028		15 300	11 830	0,36
BAHREÏN				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement bahreïni				
4,250 % éch. 25/01/2028		12 200	11 215	0,34
5,625 % éch. 30/09/2031		700	642	0,02
Total Bahreïn			11 857	0,36
BIÉLORUSSIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de Biélorussie				
5,875 % éch. 24/02/2026 ^		572	246	0,01
7,625 % éch. 29/06/2027 ^		800	344	0,01
Total Biélorussie			590	0,02
BÉNIN				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement du Bénin				
4,875 % éch. 19/01/2032	€	5 350	4 456	0,13
4,950 % éch. 22/01/2035	€	2 000	$ 1 556	0,05
Total Bénin			6 012	0,18
BRÉSIL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco do Brasil S.A.				
3,250 % éch. 30/09/2026	$	7 700	7 098	0,22
Banco Votorantim S.A.				
4,500 % éch. 24/09/2024		1 100	1 069	0,03
Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais				
5,333 % éch. 15/02/2028		26 334	25 740	0,78
CSN Inova Ventures				
6,750 % éch. 28/01/2028		15 800	15 111	0,46
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				
0,000 % éch. 30/01/2023 (c)(e)		14 563	35	0,00
Vale S.A.				
0,000 % (e)	BRL	188 860	13 352	0,40
			62 405	**1,89**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement brésilien				
4,750 % éch. 14/01/2050	$	7 000	4 927	0,15
Total Brésil			67 332	2,04
CAMEROUN				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de la République du Cameroun				
5,950 % éch. 07/07/2032	€	7 600	6 049	0,18
ÎLES CAÏMANS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AAC Technologies Holdings, Inc.				
2,625 % éch. 02/06/2026	$	4 600	3 749	0,11
Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.				
0,000 % éch. 05/06/2034 (c)		13 060	9 031	0,27
Country Garden Holdings Co. Ltd.				
2,700 % éch. 12/07/2026		500	286	0,01
3,125 % éch. 22/10/2025		400	246	0,01
5,400 % éch. 27/05/2025		1 300	867	0,03
6,150 % éch. 17/09/2025		900	591	0,02
6,500 % éch. 08/04/2024		600	455	0,01
Fab Sukuk Co. Ltd.				
3,625 % éch. 05/03/2023		1 700	1 695	0,05
Gaci First Investment Co.				
5,000 % éch. 13/10/2027		22 200	22 255	0,67
5,375 % éch. 13/10/2122		8 000	7 515	0,23
ICD Funding Ltd.				
3,223 % éch. 28/04/2026		1 830	1 695	0,05
Interoceanica Finance Ltd.				
0,000 % éch. 30/11/2025 (c)		744	611	0,02
0,000 % éch. 15/05/2030 (c)		7 030	5 458	0,17
7,860 % éch. 15/05/2030		3 730	3 723	0,11
Kaisa Group Holdings Ltd.				
8,500 % éch. 30/06/2022 ^		600	84	0,00
9,375 % éch. 30/06/2024 ^		4 100	576	0,02
9,750 % éch. 28/09/2023 ^		3 200	451	0,01
11,250 % éch. 09/04/2022 ^		1 100	141	0,00
11,500 % éch. 30/01/2023 ^		200	28	0,00
11,700 % éch. 11/11/2025 ^		3 300	465	0,01
11,950 % éch. 12/11/2023 ^		2 600	366	0,01
KSA Sukuk Ltd.				
5,268 % éch. 25/10/2028		14 500	15 090	0,46
Lima Metro Line Finance Ltd.				
4,350 % éch. 05/04/2036		371	330	0,01
5,875 % éch. 05/07/2034		1 069	1 040	0,03
New Metro Global Ltd.				
4,500 % éch. 02/05/2026		3 400	2 312	0,07
6,800 % éch. 05/08/2023		200	185	0,01
Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % en numéraire et 1,000 % de rémunération en nature)				
7,350 % éch. 01/12/2026 ^(a)		13 275	7 335	0,22
Poinsettia Finance Ltd.				
6,625 % éch. 17/06/2031		12 536	10 638	0,32
S.A. Global Sukuk Ltd.				
1,602 % éch. 17/06/2026	$	6 800	$ 6 086	0,18
2,694 % éch. 17/06/2031		4 600	3 940	0,12
Seazen Group Ltd.				
4,450 % éch. 13/07/2025		3 500	2 467	0,08
Sunac China Holdings Ltd.				
6,500 % éch. 10/01/2025 ^		8 500	1 863	0,06
7,000 % éch. 09/07/2025 ^		4 700	1 027	0,03
7,250 % éch. 14/06/2022 ^		900	189	0,01
Tencent Holdings Ltd.				
3,840 % éch. 22/04/2051		200	142	0,00
Zhongsheng Group Holdings Ltd.				
3,000 % éch. 13/01/2026		3 900	3 491	0,11
Total Îles Caïmans			116 423	3,52
CHILI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco del Estado de Chile				
2,704 % éch. 09/01/2025		4 300	4 066	0,12
Banco Santander Chile				
2,700 % éch. 10/01/2025		5 200	4 942	0,15
Corp. Nacional del Cobre de Chile				
3,625 % éch. 01/08/2027		6 700	6 291	0,19
4,500 % éch. 01/08/2047		3 200	2 727	0,08
4,875 % éch. 04/11/2044 (i)		10 600	9 679	0,29
6,150 % éch. 24/10/2036		1 000	1 046	0,03
Embotelladora Andina S.A.				
3,950 % éch. 21/01/2050		3 900	2 898	0,09
Empresa de los Ferrocarriles del Estado				
3,068 % éch. 18/08/2050		1 500	944	0,03
3,830 % éch. 14/09/2061		7 000	4 836	0,15
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro S.A.				
3,650 % éch. 07/05/2030		1 600	1 456	0,04
Empresa Nacional del Petroleo				
3,450 % éch. 16/09/2031		8 700	7 347	0,22
4,500 % éch. 14/09/2047		3 000	2 291	0,07
GNL Quintero S.A.				
4,634 % éch. 31/07/2029		7 659	7 409	0,23
			55 932	**1,69**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement chilien				
2,750 % éch. 31/01/2027 (i)		13 400	12 347	0,37
3,250 % éch. 21/09/2071		11 900	7 371	0,22
3,625 % éch. 30/10/2042		2 000	1 534	0,05
4,340 % éch. 07/03/2042		13 000	11 032	0,34
			32 284	**0,98**
Total Chili			88 216	2,67
CHINE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Yango Justice International Ltd.				
7,500 % éch. 15/04/2024 ^		4 700	171	0,01
ZhongAn Online P&C Insurance Co. Ltd.				
3,125 % éch. 16/07/2025		11 800	10 267	0,31
Total Chine			10 438	0,32
COLOMBIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Davivienda S.A.				
6,650 % éch. 22/04/2031 (e)(g)		900	695	0,02
Ecopetrol S.A.				
4,125 % éch. 16/01/2025		600	573	0,02
4,625 % éch. 02/11/2031		9 800	7 506	0,23
5,375 % éch. 26/06/2026		2 200	2 080	0,06
5,875 % éch. 18/09/2023		5 500	5 476	0,16
5,875 % éch. 28/05/2045		3 100	2 165	0,07
6,875 % éch. 29/04/2030		200	182	0,01
7,375 % éch. 18/09/2043		2 400	2 048	0,06
			20 725	**0,63**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement colombien				
2,625 % éch. 15/03/2023		5 800	5 773	0,17

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
3,125 % éch. 15/04/2031 (i)	$	17 307	$ 12 906	0,39
3,875 % éch. 25/04/2027		5 000	4 442	0,13
3,875 % éch. 15/02/2061		13 000	7 268	0,22
4,000 % éch. 26/02/2024		12 100	11 873	0,36
4,125 % éch. 15/05/2051		13 700	8 245	0,25
4,500 % éch. 15/03/2029		400	347	0,01
5,000 % éch. 15/06/2045		3 400	2 326	0,07
5,200 % éch. 15/05/2049		12 700	8 698	0,26
5,625 % éch. 26/02/2044		4 800	3 544	0,11
6,125 % éch. 18/01/2041		4 895	3 910	0,12
7,375 % éch. 18/09/2037		1 400	1 317	0,04
8,125 % éch. 21/05/2024		500	516	0,02
			71 165	**2,15**
Total Colombie			91 890	2,78
COSTA RICA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement costaricain				
4,250 % éch. 26/01/2023		6 300	6 285	0,19
5,625 % éch. 30/04/2043		3 000	2 468	0,08
Total Costa Rica			8 753	0,27
RÉPUBLIQUE DOMINICAINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Billets de la Banque centrale de la République dominicaine				
12,000 % éch. 03/10/2025	DOP	128 200	2 195	0,07
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine				
4,875 % éch. 23/09/2032	$	6 200	5 170	0,16
5,300 % éch. 21/01/2041		7 700	5 970	0,18
5,500 % éch. 27/01/2025		9 600	9 539	0,29
5,500 % éch. 22/02/2029		18 600	17 184	0,52
5,875 % éch. 30/01/2060		7 650	5 639	0,17
5,950 % éch. 25/01/2027		15 000	14 730	0,44
6,000 % éch. 19/07/2028		12 400	11 996	0,36
6,000 % éch. 22/02/2033		10 800	9 783	0,29
6,400 % éch. 05/06/2049		250	203	0,01
6,875 % éch. 29/01/2026		6 400	6 474	0,20
7,450 % éch. 30/04/2044		100	94	0,00
Total République dominicaine			88 977	2,69
ÉQUATEUR				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Ecuador Social Bond SARL				
0,000 % éch. 30/01/2035 (c)		1 063	880	0,03
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement d'Équateur				
0,000 % éch. 31/07/2030 (c)		6 032	2 367	0,07
1,500 % éch. 31/07/2040		22 463	9 213	0,28
2,500 % éch. 31/07/2035		25 871	11 969	0,36
5,500 % éch. 31/07/2030		19 026	12 214	0,37
			35 763	**1,08**
Total Équateur			36 643	1,11
ÉGYPTE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement égyptien				
4,750 % éch. 16/04/2026	€	14 508	12 918	0,39
5,625 % éch. 16/04/2030		5 370	3 997	0,12
5,875 % éch. 16/02/2031	$	5 900	4 124	0,13
6,375 % éch. 11/04/2031	€	2 300	1 713	0,05
6,875 % éch. 30/04/2040	$	3 100	2 012	0,06
7,053 % éch. 15/01/2032		7 300	5 361	0,16
7,300 % éch. 30/09/2033		14 900	10 616	0,32
7,500 % éch. 16/02/2061		2 600	1 614	0,05
7,625 % éch. 29/05/2032		6 800	5 056	0,16
7,903 % éch. 21/02/2048		9 900	6 291	0,19
8,150 % éch. 20/11/2059		2 100	1 381	0,04
8,500 % éch. 31/01/2047		9 000	6 026	0,18
8,875 % éch. 29/05/2050		12 300	8 360	0,25
Total Égypte			69 469	2,10
SALVADOR				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement salvadorien				
6,375 % éch. 18/01/2027		1 100	492	0,01
7,125 % éch. 20/01/2050	$	12 707	$ 5 031	0,15
7,625 % éch. 21/09/2034		3 800	1 520	0,05
7,625 % éch. 01/02/2041		530	210	0,01
7,650 % éch. 15/06/2035		200	81	0,00
8,250 % éch. 10/04/2032		2 610	1 162	0,04
8,625 % éch. 28/02/2029		185	83	0,00
9,500 % éch. 15/07/2052		1 400	626	0,02
Total Salvador			9 205	0,28
ÉTHIOPIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement éthiopien				
6,625 % éch. 11/12/2024		3 300	2 073	0,06
GÉORGIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Georgian Railway JSC				
4,000 % éch. 17/06/2028		300	266	0,01
ALLEMAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Deutsche Bank AG				
3,700 % éch. 30/05/2024		4 222	4 105	0,13
3,950 % éch. 27/02/2023		6 769	6 746	0,20
Total Allemagne			10 851	0,33
GHANA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement du Ghana				
6,375 % éch. 11/02/2027 ^		17 900	6 937	0,21
7,625 % éch. 16/05/2029 ^		800	302	0,01
7,750 % éch. 07/04/2029 ^		7 600	2 861	0,09
7,875 % éch. 26/03/2027 ^		6 889	2 706	0,08
7,875 % éch. 11/02/2035 ^		4 229	1 533	0,04
8,125 % éch. 26/03/2032 ^		11 200	4 109	0,12
8,625 % éch. 07/04/2034 ^		9 000	3 290	0,10
8,750 % éch. 11/03/2061 ^		1 750	620	0,02
8,875 % éch. 07/05/2042 ^		1 600	576	0,02
8,950 % éch. 26/03/2051 ^		4 600	1 652	0,05
Total Ghana			24 586	0,74
GUATEMALA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement du Guatemala				
4,375 % éch. 05/06/2027		8 600	8 170	0,24
4,500 % éch. 03/05/2026		6 900	6 650	0,20
4,650 % éch. 07/10/2041		800	646	0,02
4,875 % éch. 13/02/2028		7 120	6 883	0,21
5,375 % éch. 24/04/2032		300	296	0,01
Total Guatemala			22 645	0,68
HONG KONG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AIA Group Ltd.				
3,200 % éch. 16/09/2040		900	644	0,02
Fortune Star BVI Ltd.				
4,350 % éch. 06/05/2023	€	900	886	0,03
6,850 % éch. 02/07/2024	$	2 200	1 903	0,06
Huarong Finance Co. Ltd.				
3,375 % éch. 24/02/2030		1 100	839	0,02
3,875 % éch. 13/11/2029		300	237	0,01
4,500 % éch. 29/05/2029		3 450	2 867	0,08
5,000 % éch. 19/11/2025		3 700	3 420	0,10
5,500 % éch. 16/01/2025		200	190	0,01
5,824 % éch. 24/02/2023 (i)		9 000	8 972	0,27
			19 958	**0,60**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Airport Authority Hong Kong				
2,100 % éch. 08/03/2026 (e)		7 500	6 845	0,21
2,625 % éch. 04/02/2051		1 000	646	0,02
			7 491	**0,23**
Total Hong Kong			27 449	0,83
HONGRIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement hongrois				
0,500 % éch. 18/11/2030	€	800	$ 588	0,02
1,625 % éch. 28/04/2032		1 418	1 089	0,03
2,125 % éch. 22/09/2031	$	2 700	2 012	0,06
3,125 % éch. 21/09/2051		2 500	1 518	0,05
5,000 % éch. 22/02/2027	€	8 200	8 695	0,26
5,250 % éch. 16/06/2029	$	17 800	17 072	0,52
5,500 % éch. 16/06/2034		700	658	0,02
Total Hongrie			31 632	0,96
INDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Indian Railway Finance Corp. Ltd.				
3,950 % éch. 13/02/2050		2 200	1 581	0,04
NTPC Ltd.				
3,750 % éch. 03/04/2024		2 000	1 950	0,06
Reliance Industries Ltd.				
2,875 % éch. 12/01/2032		2 400	1 948	0,06
			5 479	**0,16**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Export-Import Bank of India				
3,375 % éch. 05/08/2026		600	563	0,02
3,875 % éch. 12/03/2024		4 100	4 019	0,12
			4 582	**0,14**
Total Inde			10 061	0,30
INDONÉSIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT				
5,450 % éch. 15/05/2030		8 000	7 634	0,23
5,800 % éch. 15/05/2050		3 000	2 520	0,08
LLPL Capital Pte. Ltd.				
6,875 % éch. 04/02/2039		939	829	0,03
Pelabuhan Indonesia Persero PT				
4,250 % éch. 05/05/2025		6 500	6 283	0,19
4,500 % éch. 02/05/2023		18 700	18 661	0,56
4,875 % éch. 01/10/2024		3 100	3 065	0,09
5,375 % éch. 05/05/2045		3 693	3 404	0,10
Pertamina Persero PT				
1,400 % éch. 09/02/2026		600	537	0,02
4,175 % éch. 21/01/2050		5 000	3 851	0,12
5,625 % éch. 20/05/2043		1 800	1 658	0,05
6,000 % éch. 03/05/2042		21 100	20 268	0,61
6,450 % éch. 30/05/2044		12 400	12 419	0,38
6,500 % éch. 07/11/2048		9 500	9 548	0,29
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				
4,000 % éch. 30/06/2050		16 800	12 054	0,36
4,125 % éch. 15/05/2027		6 300	6 063	0,18
4,375 % éch. 05/02/2050		2 900	2 178	0,07
5,250 % éch. 24/10/2042		2 300	1 965	0,06
5,250 % éch. 15/05/2047		8 400	7 102	0,21
6,150 % éch. 21/05/2048		2 700	2 570	0,08
6,250 % éch. 25/01/2049		7 800	7 405	0,22
			130 014	**3,93**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement indonésien				
1,100 % éch. 12/03/2033	€	8 400	6 588	0,20
4,750 % éch. 18/07/2047	$	2 700	2 466	0,07
5,350 % éch. 11/02/2049		200	196	0,01
6,625 % éch. 17/02/2037		5 900	6 696	0,20
6,750 % éch. 15/01/2044		4 000	4 496	0,14
7,750 % éch. 17/01/2038		1 000	1 205	0,04
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia				
3,800 % éch. 23/06/2050		7 000	5 451	0,16
			27 098	**0,82**
Total Indonésie			157 112	4,75
IRLANDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				
5,950 % éch. 15/04/2030 ^(g)		6 600	416	0,01

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Republic of Angola Via Avenir Issuer Ireland DAC				
6,927 % éch. 19/02/2027	$	25 476	$ 23 374	0,71
Russian Railways Via RZD Capital PLC				
7,487 % éch. 25/03/2031 ^	£	500	325	0,01
Total Irlande			24 115	0,73
ISRAËL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Bank Hapoalim B.M.				
3,255 % éch. 21/01/2032 (g)	$	9 900	8 561	0,26
Israel Electric Corp. Ltd.				
4,250 % éch. 14/08/2028		5 400	5 113	0,15
5,000 % éch. 12/11/2024		200	198	0,01
Leviathan Bond Ltd.				
6,500 % éch. 30/06/2027		7 300	7 107	0,21
			20 979	**0,63**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement israélien				
0,150 % éch. 31/07/2023	ILS	23 700	6 584	0,20
1,500 % éch. 30/11/2023		108 000	30 037	0,91
			36 621	**1,11**
Total Israël			57 600	1,74
CÔTE D'IVOIRE				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
République de Côte d'Ivoire				
6,608 % éch. 19/03/2027	€	3 870	3 944	0,12
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire				
4,875 % éch. 30/01/2032		6 700	5 663	0,17
5,250 % éch. 22/03/2030		500	452	0,01
5,750 % éch. 31/12/2032	$	9 817	9 309	0,28
5,875 % éch. 17/10/2031	€	2 800	2 514	0,08
6,625 % éch. 22/03/2048		300	227	0,01
			18 165	**0,55**
Total Côte d'Ivoire			22 109	0,67
JAMAÏQUE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
TransJamaican Highway Ltd.				
5,750 % éch. 10/10/2036	$	3 143	2 540	0,08
JAPON				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
5,063 % éch. 12/09/2025		16 500	16 393	0,50
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Corsair International Ltd.				
5,473 % éch. 28/01/2027	€	15 600	16 524	0,50
5,823 % éch. 28/01/2029		6 700	7 079	0,21
Total Jersey, Îles Anglo-Normandes			23 603	0,71
JORDANIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement jordanien				
4,950 % éch. 07/07/2025	$	2 200	2 116	0,06
5,750 % éch. 31/01/2027		13 200	12 758	0,38
5,850 % éch. 07/07/2030		2 100	1 889	0,06
6,125 % éch. 29/01/2026		6 250	6 198	0,19
7,375 % éch. 10/10/2047		1 100	949	0,03
Total Jordanie			23 910	0,72
KAZAKHSTAN				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
KazMunayGas National Co. JSC				
3,500 % éch. 14/04/2033		1 300	966	0,03
4,750 % éch. 24/04/2025		7 215	7 008	0,21
4,750 % éch. 19/04/2027		9 600	8 885	0,27
5,375 % éch. 24/04/2030		1 200	1 079	0,03
5,750 % éch. 19/04/2047	$	16 464	$ 12 837	0,39
6,375 % éch. 24/10/2048		3 800	3 153	0,09
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.				
3,250 % éch. 15/08/2030		10 400	7 458	0,23
			41 386	**1,25**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement kazakh				
2,375 % éch. 09/11/2028	€	200	193	0,01
6,500 % éch. 21/07/2045	$	3 680	3 845	0,11
			4 038	**0,12**
Total Kazakhstan			45 424	1,37
KENYA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement kenyan				
8,000 % éch. 22/05/2032		1 300	1 114	0,03
LIBAN				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement libanais				
8,250 % éch. 17/05/2034 ^		9 700	601	0,02
LUXEMBOURG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Constellation Oil Services Holding S.A.				
13,500 % éch. 30/06/2025		1 704	1 695	0,05
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature)				
3,000 % éch. 31/12/2026 (a)		3 789	2 242	0,07
Guara Norte SARL				
5,198 % éch. 15/06/2034		4 826	4 091	0,12
Petrorio Luxembourg Trading SARL				
6,125 % éch. 09/06/2026		7 100	6 766	0,21
Total Luxembourg			14 794	0,45
MALAISIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Axiata SPV2 Bhd.				
2,163 % éch. 19/08/2030		2 300	1 860	0,06
Petronas Capital Ltd.				
4,500 % éch. 18/03/2045		500	450	0,01
4,550 % éch. 21/04/2050		9 700	8 697	0,26
Total Malaisie			11 007	0,33
ÎLE MAURICE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Greenko Solar Mauritius Ltd.				
5,950 % éch. 29/07/2026		3 000	2 749	0,08

ACTIONS

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

		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
America Movil S.A.B. de C.V.				
5,375 % éch. 04/04/2032	$	7 250	6 554	0,20
Banco Mercantil del Norte S.A.				
6,625 % éch. 24/01/2032 (e)(g)		4 100	3 402	0,10
7,500 % éch. 27/06/2029 (e)(g)		5 400	4 953	0,15
Comision Federal de Electricidad				
6,264 % éch. 15/02/2052		5 700	4 517	0,14
Corp. GEO S.A.B. de C.V.				
8,875 % éch. 25/09/2014 ^		13 920	0	0,00
9,250 % éch. 30/06/2020 ^		1 000	0	0,00
Industrias Penoles S.A.B. de C.V.				
4,750 % éch. 06/08/2050		3 900	3 229	0,10
Petroleos Mexicanos				
3,625 % éch. 24/11/2025	€	1 400	$ 1 345	0,04
3,750 % éch. 21/02/2024		600	629	0,02
4,875 % éch. 21/02/2028		1 300	1 137	0,03
5,125 % éch. 15/03/2023		100	107	0,00
6,350 % éch. 12/02/2048	$	30 367	18 634	0,56
6,500 % éch. 02/06/2041		2 000	1 306	0,04
6,625 % éch. 15/06/2035		9 350	6 805	0,21
6,625 % éch. 15/06/2038		200	138	0,00
6,700 % éch. 16/02/2032		12 558	9 886	0,30
6,750 % éch. 21/09/2047		17 180	11 000	0,33
6,840 % éch. 23/01/2030		278	230	0,01
6,950 % éch. 28/01/2060		39 447	25 025	0,76
7,690 % éch. 23/01/2050		69 136	47 993	1,45
			146 890	**4,44**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement mexicain				
3,750 % éch. 19/04/2071		9 200	5 750	0,17
3,771 % éch. 24/05/2061		17 900	11 371	0,34
4,280 % éch. 14/08/2041		10 491	8 115	0,25
5,000 % éch. 27/04/2051 (i)		14 100	11 493	0,35
5,750 % éch. 12/10/2110		43 450	36 720	1,11
			73 449	**2,22**
Total Mexique			220 340	6,66
MONGOLIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement mongol				
3,500 % éch. 07/07/2027		2 000	1 615	0,05
MAROC				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
OCP S.A.				
3,750 % éch. 23/06/2031		10 850	9 127	0,27
5,125 % éch. 23/06/2051		10 300	7 858	0,24
Total Maroc			16 985	0,51
MULTINATIONALES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
ATP Tower Holdings LLC				
4,050 % éch. 27/04/2026		10 600	9 362	0,28
NAMIBIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement namibien				
5,250 % éch. 29/10/2025		6 000	5 640	0,17
PAYS-BAS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Metinvest BV				
7,750 % éch. 23/04/2023		475	385	0,01
8,500 % éch. 23/04/2026		5 700	3 045	0,09
Prosus NV				
1,539 % éch. 03/08/2028	€	2 400	2 081	0,06
2,031 % éch. 03/08/2032		1 200	911	0,03
3,257 % éch. 19/01/2027	$	3 900	3 492	0,11
3,832 % éch. 08/02/2051		2 100	1 276	0,04
4,027 % éch. 03/08/2050		1 600	1 004	0,03
Republic of Angola Via Avenir BV				
9,687 % éch. 07/12/2023		3 760	3 703	0,11
12,639 % éch. 01/07/2023		4 185	4 216	0,13
Total Pays-Bas			20 113	0,61
NIGERIA				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BOI Finance BV				
7,500 % éch. 16/02/2027	€	14 400	12 411	0,38
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement nigérian				
6,125 % éch. 28/09/2028	$	8 200	6 366	0,19
6,375 % éch. 12/07/2023		8 650	8 590	0,26
7,143 % éch. 23/02/2030		7 000	5 386	0,16
7,375 % éch. 28/09/2033		9 400	6 724	0,20
7,625 % éch. 21/11/2025		200	185	0,01

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
7,625 % éch. 28/11/2047	$	11 846	$ 7 672	0,23
7,696 % éch. 23/02/2038		4 800	3 278	0,10
8,250 % éch. 28/09/2051		4 400	2 952	0,09
			41 153	**1,24**
Total Nigeria			53 564	1,62
OMAN				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement omanais				
4,125 % éch. 17/01/2023		2 100	2 098	0,06
4,875 % éch. 01/02/2025		1 100	1 083	0,03
5,625 % éch. 17/01/2028		6 690	6 624	0,20
6,000 % éch. 01/08/2029		16 100	16 199	0,49
6,250 % éch. 25/01/2031		7 700	7 772	0,23
6,500 % éch. 08/03/2047		3 473	3 177	0,10
6,750 % éch. 28/10/2027		13 900	14 430	0,44
6,750 % éch. 17/01/2048		3 900	3 666	0,11
7,000 % éch. 25/01/2051		2 400	2 328	0,07
Total Oman			57 377	1,73
PAKISTAN				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement pakistanais				
6,000 % éch. 08/04/2026		3 952	1 591	0,05
6,875 % éch. 05/12/2027		3 500	1 387	0,04
7,375 % éch. 08/04/2031		3 870	1 393	0,05
8,250 % éch. 15/04/2024		5 500	2 998	0,09
8,875 % éch. 08/04/2051		10 500	3 701	0,11
Total Pakistan			11 070	0,34
PANAMA				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.				
5,125 % éch. 11/08/2061		7 100	5 836	0,18
Banco General S.A.				
5,250 % éch. 07/05/2031 (e)(g)		400	331	0,01
5,250 % éch. 07/05/2031 (e)		8 300	6 879	0,21
Banco Nacional de Panama				
2,500 % éch. 11/08/2030		5 900	4 739	0,14
			17 785	**0,54**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement panaméen				
3,870 % éch. 23/07/2060		1 400	908	0,03
4,300 % éch. 29/04/2053		2 000	1 452	0,04
4,500 % éch. 15/05/2047		7 300	5 638	0,17
4,500 % éch. 16/04/2050		6 600	5 003	0,15
4,500 % éch. 01/04/2056		3 400	2 491	0,07
4,500 % éch. 19/01/2063		8 200	5 808	0,18
6,400 % éch. 14/02/2035		9 800	9 971	0,30
6,700 % éch. 26/01/2036		1 300	1 360	0,04
8,125 % éch. 28/04/2034		300	359	0,01
8,875 % éch. 30/09/2027		1 700	1 961	0,06
			34 951	**1,05**
Total Panama			52 736	1,59
PARAGUAY				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement paraguayen				
2,739 % éch. 29/01/2033		1 900	1 533	0,05
3,849 % éch. 28/06/2033		2 600	2 292	0,07
4,700 % éch. 27/03/2027		1 800	1 775	0,05
5,400 % éch. 30/03/2050		4 400	3 808	0,11
6,100 % éch. 11/08/2044		2 400	2 318	0,07
Total Paraguay			11 726	0,35
PÉROU				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % éch. 17/09/2024	PEN	26 100	6 392	0,19
Cia de Minas Buenaventura SAA				
5,500 % éch. 23/07/2026	$	3 000	2 577	0,08
InRetail Consumer				
3,250 % éch. 22/03/2028		6 300	5 426	0,16
Peru LNG SRL				
5,375 % éch. 22/03/2030	$	6 974	$ 5 835	0,18
Petroleos del Peru S.A.				
4,750 % éch. 19/06/2032		2 600	2 014	0,06
5,625 % éch. 19/06/2047		17 869	11 719	0,36
			33 963	**1,03**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement péruvien				
3,230 % éch. 28/07/2121		1 900	1 110	0,03
3,600 % éch. 15/01/2072		2 600	1 701	0,05
6,550 % éch. 14/03/2037		943	997	0,03
8,750 % éch. 21/11/2033		785	958	0,03
			4 766	**0,14**
Total Pérou			38 729	1,17
PHILIPPINES				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement philippin				
2,650 % éch. 10/12/2045		7 900	5 345	0,16
2,950 % éch. 05/05/2045		1 600	1 159	0,03
3,700 % éch. 01/03/2041		650	533	0,02
6,375 % éch. 23/10/2034		847	941	0,03
7,750 % éch. 14/01/2031		600	714	0,02
9,500 % éch. 02/02/2030		4 179	5 344	0,16
Total Philippines			14 036	0,42
POLOGNE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement polonais				
5,500 % éch. 16/11/2027		12 050	12 403	0,38
QATAR				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
QatarEnergy Trading LLC				
2,250 % éch. 12/07/2031		7 300	6 061	0,18
3,125 % éch. 12/07/2041		23 100	17 836	0,54
3,300 % éch. 12/07/2051		38 800	28 743	0,87
			52 640	**1,59**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement qatari				
4,400 % éch. 16/04/2050		1 600	1 468	0,04
4,625 % éch. 02/06/2046		300	284	0,01
5,103 % éch. 23/04/2048		480	484	0,02
			2 236	**0,07**
Total Qatar			54 876	1,66
ROUMANIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement roumain				
1,750 % éch. 13/07/2030	€	11 600	8 651	0,26
2,000 % éch. 08/12/2026		3 900	3 741	0,11
2,124 % éch. 16/07/2031		1 000	739	0,02
2,125 % éch. 07/03/2028		4 700	4 199	0,13
2,375 % éch. 19/04/2027		1 750	1 672	0,05
2,625 % éch. 02/12/2040		7 400	4 425	0,13
2,875 % éch. 26/05/2028		1 600	1 480	0,05
2,875 % éch. 13/04/2042		3 400	2 041	0,06
3,500 % éch. 03/04/2034		4 200	3 289	0,10
3,750 % éch. 07/02/2034		3 155	2 521	0,08
3,875 % éch. 29/10/2035		100	79	0,00
4,000 % éch. 14/02/2051	$	2 700	1 803	0,06
4,125 % éch. 11/03/2039	€	1 000	765	0,02
4,625 % éch. 03/04/2049		5 600	4 339	0,13
5,000 % éch. 27/09/2026		15 000	16 139	0,49
6,125 % éch. 22/01/2044	$	4 050	3 740	0,11
Total Roumanie			59 623	1,80
RUSSIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
SCF Capital Designated Activity Co.				
5,375 % éch. 16/06/2023		1 200	601	0,02
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement russe				
1,125 % éch. 20/11/2027 ^	€	500	$ 155	0,01
1,850 % éch. 20/11/2032		8 900	2 754	0,08
4,250 % éch. 23/06/2027 ^	$	800	280	0,01
4,375 % éch. 21/03/2029 ^		5 000	1 500	0,05
4,750 % éch. 27/05/2026 ^		400	140	0,00
5,100 % éch. 28/03/2035 ^		3 400	1 122	0,03
5,250 % éch. 23/06/2047 ^		1 600	592	0,02
7,500 % éch. 31/03/2030 ^		174	113	0,00
			6 656	**0,20**
Total Russie			7 257	0,22
ARABIE SAOUDITE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Saudi Arabian Oil Co.				
2,250 % éch. 24/11/2030		1 900	1 570	0,05
2,875 % éch. 16/04/2024		600	582	0,02
3,500 % éch. 16/04/2029		3 000	2 761	0,08
3,500 % éch. 24/11/2070		47 500	32 444	0,98
			37 357	**1,13**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite				
2,250 % éch. 02/02/2033		2 000	1 628	0,05
3,450 % éch. 02/02/2061		9 900	7 118	0,21
3,750 % éch. 21/01/2055		8 600	6 800	0,20
4,500 % éch. 26/10/2046 (i)		26 600	23 674	0,72
4,625 % éch. 04/10/2047		300	269	0,01
			39 489	**1,19**
Total Arabie saoudite			76 846	2,32
SÉNÉGAL				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement sénégalais				
4,750 % éch. 13/03/2028	€	3 400	3 139	0,10
5,375 % éch. 08/06/2037		1 800	1 297	0,04
6,250 % éch. 23/05/2033	$	2 950	2 447	0,07
6,750 % éch. 13/03/2048		800	568	0,02
Total Sénégal			7 451	0,23
SERBIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement serbe				
1,000 % éch. 23/09/2028	€	1 500	1 155	0,03
1,500 % éch. 26/06/2029		7 400	5 675	0,17
1,650 % éch. 03/03/2033		16 700	10 873	0,33
2,050 % éch. 23/09/2036		4 100	2 481	0,08
3,125 % éch. 15/05/2027		2 700	2 486	0,08
Total Serbie			22 670	0,69
SINGAPOUR				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Flex Ltd.				
4,875 % éch. 15/06/2029	$	1 300	1 226	0,04
Medco Bell Pte. Ltd.				
6,375 % éch. 30/01/2027		7 100	6 430	0,19
Singapore Airlines Ltd.				
3,375 % éch. 19/01/2029		9 800	8 857	0,27
Total Singapour			16 513	0,50
AFRIQUE DU SUD				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AngloGold Ashanti Holdings PLC				
3,750 % éch. 01/10/2030		3 600	3 126	0,09
6,500 % éch. 15/04/2040		200	192	0,01
Banque de développement d'Afrique du Sud				
8,600 % éch. 21/10/2024 (h)	ZAR	467 300	27 043	0,82
Eskom Holdings SOC Ltd.				
4,314 % éch. 23/07/2027	$	16 250	14 236	0,43
6,350 % éch. 10/08/2028		14 400	13 367	0,40
6,750 % éch. 06/08/2023		400	386	0,01
7,125 % éch. 11/02/2025		4 300	3 926	0,12
8,450 % éch. 10/08/2028		11 200	9 866	0,30

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Growthpoint Properties International Pty. Ltd.				
5,872 % éch. 02/05/2023	$	5 200	$ 5 181	0,16
Sasol Financing USA LLC				
5,875 % éch. 27/03/2024		5 815	5 703	0,17
			83 026	**2,51**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement sud-africain				
4,850 % éch. 30/09/2029		19 600	17 543	0,53
5,000 % éch. 12/10/2046		10 200	7 188	0,22
5,375 % éch. 24/07/2044		400	303	0,01
5,750 % éch. 30/09/2049		6 400	4 729	0,14
5,875 % éch. 20/04/2032		3 000	2 717	0,08
7,300 % éch. 20/04/2052		5 300	4 590	0,14
10,500 % éch. 21/12/2026 (i)	ZAR	330 100	20 510	0,62
10,500 % éch. 21/12/2026		123 000	7 642	0,23
			65 222	**1,97**
Total Afrique du Sud			148 248	4,48
ESPAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Santander S.A.				
5,147 % éch. 18/08/2025	$	13 600	13 463	0,41
SRI LANKA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement du Sri Lanka				
5,750 % éch. 18/04/2023 ^		5 970	1 895	0,06
5,875 % éch. 25/07/2022 ^		2 050	677	0,02
6,125 % éch. 03/06/2025 ^		5 100	1 669	0,05
6,200 % éch. 11/05/2027 ^		8 200	2 617	0,08
6,825 % éch. 18/07/2026 ^		1 200	384	0,01
6,850 % éch. 03/11/2025 ^		6 500	2 097	0,06
7,550 % éch. 28/03/2030 ^		19 300	6 158	0,19
7,850 % éch. 14/03/2029 ^		3 600	1 153	0,03
Total Sri Lanka			16 650	0,50
SUPRANATIONALES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banque de développement et de commerce d'Afrique orientale et australe				
4,125 % éch. 30/06/2028		8 300	6 880	0,21
SUISSE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Credit Suisse AG				
4,750 % éch. 09/08/2024		6 000	5 733	0,17
Credit Suisse Group AG				
2,593 % éch. 11/09/2025		6 000	5 308	0,16
4,194 % éch. 01/04/2031		3 300	2 568	0,08
6,373 % éch. 15/07/2026		4 500	4 229	0,13
6,537 % éch. 12/08/2033		1 900	1 672	0,05
UBS Group AG				
4,490 % éch. 05/08/2025		5 900	5 802	0,17
4,988 % éch. 05/08/2033		2 000	1 857	0,06
Total Suisse			27 169	0,82
TANZANIE				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Ministère des Finances et de la Planification, Gouvernement de la République unie de Tanzanie				
7,737 % éch. 26/04/2028	€	15 600	16 426	0,50
THAÏLANDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Bangkok Bank PCL				
3,733 % éch. 25/09/2034 (g)	$	800	670	0,02
GC Treasury Center Co. Ltd.				
2,980 % éch. 18/03/2031		3 000	2 427	0,07
Thaioil Treasury Center Co. Ltd.				
3,750 % éch. 18/06/2050		300	187	0,01
Total Thaïlande			3 284	0,10

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
TUNISIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de la Banque centrale de Tunisie				
3,280 % éch. 09/08/2027	¥	200 000	$ 751	0,02
5,625 % éch. 17/02/2024	€	4 100	3 456	0,11
5,750 % éch. 30/01/2025 (i)	$	2 800	1 950	0,06
6,750 % éch. 31/10/2023	€	3 400	3 059	0,09
Total Tunisie			9 216	0,28
TURQUIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Turkish Airlines Pass-Through Trust				
4,200 % éch. 15/09/2028	$	4 017	3 518	0,11
Turkiye Is Bankasi A/S				
6,125 % éch. 25/04/2024		2 200	2 187	0,06
Yapi ve Kredi Bankasi A/S				
5,850 % éch. 21/06/2024		600	591	0,02
			6 296	**0,19**
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
SOCAR Turkey Enerji A/S				
4,214 % éch. 11/08/2026	€	19 884	20 267	0,61
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Export-Credit Bank of Turkey				
5,750 % éch. 06/07/2026	$	3 500	3 194	0,10
Obligation internationale du gouvernement turc				
4,875 % éch. 09/10/2026		6 000	5 392	0,16
4,875 % éch. 16/04/2043		6 800	4 444	0,14
5,125 % éch. 17/02/2028		22 300	19 378	0,59
5,750 % éch. 11/05/2047		59 500	40 758	1,23
5,950 % éch. 15/01/2031		24 000	19 929	0,60
6,000 % éch. 25/03/2027		7 000	6 414	0,19
6,000 % éch. 14/01/2041		18 635	13 575	0,41
6,125 % éch. 24/10/2028		5 200	4 659	0,14
6,875 % éch. 17/03/2036		17 970	15 101	0,46
9,875 % éch. 15/01/2028		10 900	11 329	0,34
			144 173	**4,36**
Total Turquie			170 736	5,16
UKRAINE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
NPC Ukrenergo				
6,875 % éch. 09/11/2028 ^		7 800	1 388	0,04
Obligation internationale du gouvernement ukrainien				
4,375 % éch. 27/01/2032 ^	€	5 200	1 034	0,03
6,876 % éch. 21/05/2031	$	2 400	480	0,02
7,253 % éch. 15/03/2035		12 839	2 568	0,08
7,375 % éch. 25/09/2034 ^		5 020	967	0,03
7,750 % éch. 01/09/2026 ^		5 000	1 091	0,03
7,750 % éch. 01/09/2027		6 000	1 303	0,04
			7 443	**0,23**
Total Ukraine			8 831	0,27
ÉMIRATS ARABES UNIS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC				
3,650 % éch. 02/11/2029		4 200	3 941	0,12
4,600 % éch. 02/11/2047		5 600	5 167	0,16
DP World Ltd.				
4,700 % éch. 30/09/2049		1 800	1 520	0,04
5,625 % éch. 25/09/2048		3 475	3 272	0,10
6,850 % éch. 02/07/2037		4 880	5 201	0,16
Kuwait Projects Co. SPC Ltd.				
4,500 % éch. 23/02/2027		4 000	3 379	0,10
5,000 % éch. 15/03/2023		2 700	2 680	0,08
MDGH GMTN RSC Ltd.				
3,950 % éch. 21/05/2050		1 600	1 399	0,04
			26 559	**0,80**

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
NMC OpCo Ltd.				
10,358 % éch. 25/03/2027	AED	36 775	$ 9 913	0,30
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi				
3,125 % éch. 30/09/2049	$	900	668	0,02
3,875 % éch. 16/04/2050		15 300	13 018	0,39
Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat de Dubaï				
3,900 % éch. 09/09/2050		1 700	1 225	0,04
Département des finances du gouvernement de Sharjah				
4,000 % éch. 28/07/2050		9 000	5 928	0,18
4,375 % éch. 10/03/2051		7 900	5 343	0,16
			26 182	**0,79**
Total Émirats arabes unis			62 654	1,89
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Antofagasta PLC				
2,375 % éch. 14/10/2030		2 200	1 769	0,05
Barclays PLC				
4,375 % éch. 11/09/2024		200	195	0,01
5,304 % éch. 09/08/2026		8 400	8 346	0,25
5,746 % éch. 09/08/2033		1 900	1 800	0,05
HSBC Holdings PLC				
3,973 % éch. 22/05/2030		400	351	0,01
4,041 % éch. 13/03/2028		1 000	923	0,03
4,583 % éch. 19/06/2029		300	277	0,01
5,210 % éch. 11/08/2028		3 500	3 382	0,10
5,402 % éch. 11/08/2033		900	836	0,03
Lloyds Banking Group PLC				
4,582 % éch. 10/12/2025		1 000	969	0,03
4,716 % éch. 11/08/2026		3 700	3 624	0,11
4,976 % éch. 11/08/2033		4 400	4 053	0,12
NatWest Group PLC				
2,875 % éch. 19/09/2026	£	400	442	0,01
4,269 % éch. 22/03/2025	$	200	196	0,01
4,800 % éch. 05/04/2026		1 100	1 077	0,03
5,076 % éch. 27/01/2030		200	189	0,01
Standard Chartered PLC				
7,767 % éch. 16/11/2028		10 000	10 612	0,32
State Savings Bank of Ukraine Via SSB PLC				
9,375 % éch. 10/03/2023		422	305	0,01
Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC				
8,250 % éch. 09/07/2024		16 100	3 472	0,10
Ukreximbank Via Biz Finance PLC				
9,750 % éch. 22/01/2025		1 822	619	0,02
			43 437	**1,31**
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Canada Square Funding PLC				
3,735 % éch. 17/01/2059	£	2 856	3 304	0,10
Polaris PLC				
4,682 % éch. 27/05/2057		350	419	0,01
RMAC PLC				
4,206 % éch. 12/06/2046		2 298	2 750	0,08
Rochester Financing PLC				
4,126 % éch. 18/12/2044		3 233	3 750	0,11
Stratton Mortgage Funding PLC				
4,287 % éch. 12/03/2052		749	898	0,03
Towd Point Mortgage Funding PLC				
4,171 % éch. 20/05/2045		1 257	1 489	0,04
4,471 % éch. 20/02/2054		2 659	3 186	0,10
Tower Bridge Funding PLC				
4,151 % éch. 20/12/2063		2 029	2 380	0,07
Warwick Finance Residential Mortgages PLC				
0,000 % éch. 21/12/2049 (c)		0	573	0,02
4,387 % éch. 21/12/2049		3 731	4 488	0,14
5,087 % éch. 21/12/2049		735	884	0,03
5,587 % éch. 21/12/2049		367	441	0,01
6,087 % éch. 21/12/2049		210	253	0,01
6,587 % éch. 21/12/2049		210	253	0,01
			25 068	**0,76**
Total Royaume-Uni			68 505	2,07

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÉTATS-UNIS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Aames Mortgage Investment Trust				
4,869 % éch. 25/04/2036	$	3 052	$ 2 725	0,08
Argent Mortgage Loan Trust				
4,869 % éch. 25/05/2035		467	418	0,01
Argent Securities Trust				
4,689 % éch. 25/07/2036		976	845	0,03
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,869 % éch. 25/02/2037		1 648	1 580	0,05
5,514 % éch. 25/11/2035		3 660	3 524	0,11
GSAA Home Equity Trust				
4,829 % éch. 25/05/2047		754	494	0,01
4,869 % éch. 25/11/2036		266	99	0,00
6,502 % éch. 25/11/2036		887	349	0,01
Home Equity Asset Trust				
5,739 % éch. 25/02/2033		236	226	0,01
Humboldt Americas LLC				
0,000 % éch. 31/07/2022	COP	20 000 000	3 990	0,12
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
4,659 % éch. 25/08/2036	$	100	89	0,00
Lehman XS Trust				
5,049 % éch. 25/01/2036 ^		2 143	1 971	0,06
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
4,829 % éch. 25/11/2036		1 107	675	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
4,589 % éch. 25/02/2037		1 455	710	0,02
5,154 % éch. 25/01/2035		185	169	0,01
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
4,849 % éch. 25/02/2037		182	50	0,00
Option One Mortgage Loan Trust				
4,609 % éch. 25/04/2037		751	533	0,02
4,609 % éch. 25/05/2037		581	354	0,01
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,169 % éch. 25/09/2035		3 900	3 256	0,10
Renaissance Home Equity Loan Trust				
5,797 % éch. 25/08/2036		780	316	0,01
Saxon Asset Securities Trust				
4,699 % éch. 25/09/2037		286	269	0,01
Soundview Home Loan Trust				
4,559 % éch. 25/08/2037		614	527	0,02
4,889 % éch. 25/11/2036		74	69	0,00
4,914 % éch. 25/03/2036		693	685	0,02
5,289 % éch. 25/10/2037		1 350	1 054	0,03
			24 977	**0,76**

DESCRIPTION	ACTIONS			
ACTIONS ORDINAIRES				
ÉNERGIE				
Constellation Oil Services Holding S.A. « B » (b)(h)		4 243 669	460	0,01

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
DAE Funding LLC				
1,625 % éch. 15/02/2024	$	4 700	4 464	0,14
2,625 % éch. 20/03/2025		3 500	3 279	0,10
JPMorgan Structured Products BV				
12,000 % éch. 04/01/2027 (h)	ZMW	47 000	1 793	0,05
14,000 % éch. 09/12/2031 (h)		14 300	429	0,01
Pricoa Global Funding				
4,200 % éch. 28/08/2025	$	450	441	0,01
Rio Oil Finance Trust				
8,200 % éch. 06/04/2028		8 682	8 810	0,28
9,250 % éch. 06/07/2024		4 846	4 919	0,15
9,750 % éch. 06/01/2027		6 814	7 089	0,22
Rutas 2 and 7 Finance Ltd.				
0,000 % éch. 30/09/2036 (c)		5 227	3 303	0,10
			34 527	**1,06**

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Banc of America Mortgage Trust				
2,843 % éch. 25/02/2036 ^	$	4	$ 4	0,00
BCAP LLC Trust				
2,980 % éch. 26/05/2037		3 628	3 226	0,10
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,255 % éch. 25/05/2047 ^		90	80	0,00
3,810 % éch. 25/01/2035		4	4	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,115 % éch. 25/05/2035		64	60	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust				
3,871 % éch. 25/09/2037 ^		175	151	0,00
CitiMortgage Alternative Loan Trust				
5,039 % éch. 25/10/2036		1 085	913	0,03
Countrywide Alternative Loan Trust				
4,739 % éch. 25/05/2036 ^		1 051	465	0,01
4,993 % éch. 20/12/2035		608	531	0,02
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
3,229 % éch. 20/05/2036 ^		87	79	0,00
3,726 % éch. 25/11/2037		440	396	0,01
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				
4,540 % éch. 25/11/2034		221	209	0,01
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				
4,719 % éch. 25/08/2037 ^		736	624	0,02
GSMPS Mortgage Loan Trust				
4,739 % éch. 25/01/2036		152	126	0,00
GSR Mortgage Loan Trust				
3,796 % éch. 25/01/2036 ^		25	24	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust				
4,048 % éch. 19/10/2035		101	57	0,00
HomeBanc Mortgage Trust				
4,909 % éch. 25/01/2036		260	244	0,01
Impac CMB Trust				
5,029 % éch. 25/03/2035		83	76	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust				
3,141 % éch. 25/11/2037		217	177	0,01
4,749 % éch. 25/02/2037 ^		324	285	0,01
4,749 % éch. 25/02/2037		1 029	972	0,03
5,029 % éch. 25/07/2045		342	284	0,01
JPMorgan Resecuritization Trust				
2,500 % éch. 25/03/2056		254	239	0,01
Lehman XS Trust				
4,769 % éch. 25/09/2046		2 171	1 811	0,05
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
6,000 % éch. 25/08/2036 ^		359	281	0,01
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
4,081 % éch. 25/09/2037		21	19	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
4,539 % éch. 25/02/2037		745	655	0,02
SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,691 % éch. 25/10/2037 ^		582	507	0,02
TBW Mortgage-Backed Trust				
6,540 % éch. 25/01/2037 ^		1 283	337	0,01
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,118 % éch. 25/01/2046		87	74	0,00
3,122 % éch. 25/03/2036		927	833	0,03
3,266 % éch. 25/02/2037 ^		161	142	0,00
4,759 % éch. 25/05/2034		150	140	0,00
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				
4,479 % éch. 25/10/2036		346	317	0,01
			14 342	**0,43**
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Fannie Mae				
2,323 % éch. 01/03/2036		14	14	0,00
3,868 % éch. 01/12/2035		9	8	0,00
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)				
5,500 % éch. 01/02/2038		1	1	0,00
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				
2,500 % éch. 01/01/2053		12 450	10 545	0,32
3,500 % éch. 01/02/2053		14 100	12 820	0,39
			23 388	**0,71**
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Obligations du Trésor américain				
1,750 % éch. 15/08/2041		12 300	8 424	0,25

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
2,375 % éch. 15/02/2042	$	25 000	$ 19 100	0,58
3,250 % éch. 15/05/2042		113 500	99 560	3,02
3,375 % éch. 15/08/2042		17 800	15 914	0,48
Billets du Trésor américain				
2,375 % éch. 15/05/2029		7 900	7 183	0,22
2,625 % éch. 31/07/2029		30 000	27 631	0,84
3,125 % éch. 31/08/2029		52 000	49 373	1,50
			227 185	**6,89**

DESCRIPTION	ACTIONS			
BONS DE SOUSCRIPTION				
Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10/06/2071 (h)		5	0	0,00
Total États-Unis			324 879	9,86

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
OUZBÉKISTAN				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement ouzbek				
3,700 % éch. 25/11/2030	$	200	168	0,01
3,900 % éch. 19/10/2031		8 400	6 930	0,20
Total Ouzbékistan			7 098	0,21
VENEZUELA				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Petroleos de Venezuela S.A.				
5,375 % éch. 12/04/2027 ^		73 690	3 592	0,10
5,500 % éch. 12/04/2037 ^		19 365	945	0,03
6,000 % éch. 16/05/2024 ^		3 500	179	0,01
			4 716	**0,14**
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement vénézuélien				
7,000 % éch. 31/03/2038 ^		19 650	1 769	0,05
7,650 % éch. 21/04/2025 ^		6 624	580	0,02
7,750 % éch. 13/10/2019 ^		20 130	1 611	0,05
8,250 % éch. 13/10/2024 ^		12 483	1 092	0,03
9,000 % éch. 07/05/2023 ^		9 878	864	0,03
9,250 % éch. 15/09/2027 ^		13 410	1 274	0,04
9,250 % éch. 07/05/2028 ^		11 868	1 068	0,03
11,950 % éch. 05/08/2031 ^		2 930	278	0,01
			8 536	**0,26**
Total Venezuela			13 252	0,40
VIETNAM				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement vietnamien				
4,800 % éch. 19/11/2024		500	495	0,02
ÎLES VIERGES BRITANNIQUES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
1MDB Global Investments Ltd.				
4,400 % éch. 09/03/2023		16 700	16 351	0,49
CLP Power Hong Kong Financing Ltd.				
2,125 % éch. 30/06/2030		5 300	4 291	0,13
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.				
5,125 % éch. 15/05/2024		500	496	0,02
Total Îles Vierges britanniques			21 138	0,64
ZAMBIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement zambien				
5,375 % éch. 20/09/2022 ^		4 050	1 705	0,05
8,500 % éch. 14/04/2024 ^		2 100	964	0,03
8,970 % éch. 30/07/2027 ^		2 300	1 036	0,03
Total Zambie			3 705	0,11
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BILLETS DE TRÉSORERIE				
Constellation Brands, Inc.				
5,000 % éch. 09/01/2023		400	399	0,01

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Crown Castle International Corp.				
5,000 % éch. 04/01/2023	$	4 500	$ 4 497	0,14
5,150 % éch. 10/01/2023		2 400	2 396	0,07
Duke Energy Corp.				
4,620 % éch. 17/01/2023		3 100	3 093	0,09
Humana, Inc.				
4,850 % éch. 10/01/2023		1 800	1 797	0,05
National Grid Holdings Ltd.				
4,780 % éch. 23/01/2023		4 000	3 988	0,12
4,810 % éch. 24/01/2023		2 200	2 193	0,07
Oracle Corp.				
4,760 % éch. 27/01/2023		3 700	3 687	0,11
4,800 % éch. 26/01/2023		2 950	2 940	0,09
Quanta Services, Inc.				
5,100 % éch. 09/01/2023		1 250	1 248	0,04
5,100 % éch. 11/01/2023		900	899	0,03
VW Credit, Inc.				
4,750 % éch. 24/01/2023		2 850	2 841	0,09
			29 978	**0,91**
BONS DU TRÉSOR HONGROIS				
18,250 % éch. 03/01/2023 (c)(d)	HUF	13 219 000	35 230	1,06

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN				
0,889 % éch. 03/05/2023 (c)(d)	ILS	132 800	$ 37 196	1,12
1,716 % éch. 05/07/2023 (c)(d)		62 700	17 441	0,53
1,718 % éch. 03/05/2023 (c)(d)		7 000	1 961	0,06
1,727 % éch. 05/07/2023 (c)(d)		3 100	862	0,03
1,734 % éch. 05/07/2023 (c)(d)		85 400	23 755	0,72
1,755 % éch. 05/07/2023 (c)(d)		26 400	7 343	0,22
1,783 % éch. 03/05/2023 (c)(d)		25 300	7 086	0,21
1,828 % éch. 02/08/2023 (c)(d)		84 000	23 303	0,70
1,837 % éch. 02/08/2023 (c)(d)		109 600	30 405	0,92
			149 352	**4,51**
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS				
(0,129) % éch. 13/02/2023 (c)(d)	¥	3 902 500	29 583	0,89
(0,125) % éch. 13/02/2023 (c)(d)		1 067 500	8 092	0,25

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
(0,118) % éch. 13/02/2023 (c)(d)	¥	8 510 000	$ 64 510	1,96
			102 185	**3,10**
Total des Instruments à court terme			316 745	9,58
Total des Valeurs mobilières			**$ 3 267 661**	**98,83**

ACTIONS

FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (f)	2 357 350	23 621	0,71
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	2 416 750	24 056	0,73
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (f)	384 360	5 120	0,16
Total des Fonds d'investissement		**$ 52 797**	**1,60**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
FICC	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 9 160	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 08/06/2023	$ (9 343)	$ 9 160	$ 9 161	0,28
Total des Contrats de mise en pension						**$ (9 343)**	**$ 9 160**	**$ 9 161**	**0,28**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Long	03/2023	453	$ (1 749)	(0,05)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	459	4 181	0,13
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	Court	03/2023	68	1 783	0,05
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Court	03/2023	75	1 515	0,04
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Court	03/2023	291	(80)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Court	03/2023	3 365	537	0,02
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	6 705	(5 793)	(0,18)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Long	03/2023	300	(62)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	116	21	0,00
				$ 353	0,01
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ 353**	**0,01**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Standard Chartered PLC	(1,000) %	20/12/2027	€ 10 000	$ (133)	0,00

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[2]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AT&T, Inc.	1,000 %	20/06/2023	$ 300	$ 1	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2024	500	1	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2023	1 500	7	0,00
				$ 9	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[2]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.EM-38 à 5 ans	1,000 %	20/12/2027	$ 79 900	$ (519)	(0,02)

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance		Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000 %	21/09/2024	$	90 600	$ 2 311	0,07
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2029		11 100	(1 251)	(0,04)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024		93 700	(1 562)	(0,05)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,415	04/01/2027	BRL	104 000	(541)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,453	04/01/2027		57 600	(290)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,620	04/01/2027		15 800	(67)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,828	02/01/2025		87 000	(226)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,220	02/01/2025		210 200	(550)	(0,02)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,015	04/01/2027		102 700	(223)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,190	02/01/2025		36 500	(53)	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,215	02/01/2025		38 600	(59)	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,400	02/01/2025		86 600	(176)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	13,400	02/01/2025		124 500	257	0,01
À recevoir[4]	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,750	15/03/2028	CNY	348 226	22	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	21/06/2027	$	13 700	(2 256)	(0,07)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	15/12/2028		400	(55)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,750	15/12/2031		5 700	(1 002)	(0,03)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,250	21/12/2046		1 200	537	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,500	15/06/2046		600	277	0,01
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	5,950	30/11/2024	ZAR	560 000	1 094	0,03
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,820	28/12/2027	CLP	3 300 400	4	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,700	28/12/2025		11 322 100	10	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,700	30/12/2025		555 000	0	0,00
À recevoir[4]	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,757	03/01/2026		10 955 500	(23)	0,00
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	€	8 000	88	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,470	21/04/2025	MXN	182 700	1 001	0,03
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,520	24/04/2025		175 900	969	0,03
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,530	24/04/2025		37 200	205	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,615	23/04/2025		719 200	4 024	0,12
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,080	26/02/2025		196 200	(1 156)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,100	26/02/2025		58 000	(343)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,100	28/02/2025		372 800	(2 200)	(0,07)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,140	26/02/2025		65 000	(386)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,150	26/02/2025		388 000	(2 310)	(0,07)
						$ (3 930)	(0,12)
Total des Instruments financiers dérivés compensés						**$ (4 573)**	**(0,14)**

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

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

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

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

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

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement omanais	(1,000) %	20/12/2027	$ 2 300	$ 76	$ 11	$ 87	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/12/2026	8 500	1 413	(329)	1 084	0,03
BPS	Obligation internationale du gouvernement omanais	(1,000)	20/12/2027	1 100	36	5	41	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement omanais	(1,000)	20/12/2027	2 400	64	26	90	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/12/2026	3 900	651	(154)	497	0,02
GST	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/06/2027	20 900	(729)	308	(421)	(0,01)
HUS	Obligation internationale du gouvernement de Dubaï	(1,000)	20/12/2024	3 600	(12)	(27)	(39)	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement de Dubaï	(1,000)	20/12/2024	1 500	(2)	(14)	(16)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	(1,000)	20/06/2026	27 250	1 274	(479)	795	0,02
	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/12/2025	6 300	608	(15)	593	0,02
MYC	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/12/2026	800	135	(33)	102	0,00
					$ 3 514	$ (701)	$ 2 813	0,08

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[2]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000 %	20/06/2024	$ 8 100	$ 26	$ 35	$ 61	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2026	700	4	0	4	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2027	5 000	(18)	0	(18)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2024	13 200	4	78	82	0,00
	Obligation internationale du gouvernement du Monténégro	1,000	20/06/2023	€ 1 800	(140)	115	(25)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	$ 2 900	26	(16)	10	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/12/2031	2 000	(84)	(21)	(105)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2025	9 600	(526)	340	(186)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2027	5 500	(1 085)	294	(791)	(0,02)
BPS	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2027	2 500	(171)	10	(161)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2023	1 100	2	5	7	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2024	5 400	6	43	49	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2026	6 800	39	(4)	35	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/06/2027	10 000	(182)	189	7	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chinois	1,000	20/12/2027	5 000	62	(3)	59	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2023	5 800	(3)	(4)	(7)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement indonésien	1,000	20/12/2027	5 000	22	(20)	2	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2023	900	1	4	5	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2024	3 900	(6)	30	24	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	2 000	(4)	18	14	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2026	4 900	6	(13)	(7)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	32 100	116	(9)	107	0,00
	Obligation internationale du gouvernement philippin	1,000	20/12/2027	15 000	67	(42)	25	0,00
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/12/2023	900	3	0	3	0,00
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/12/2027	2 150	(15)	(2)	(17)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement roumain	1,000	20/12/2023	1 800	(8)	6	(2)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement roumain	1,000	20/12/2027	1 100	(80)	(4)	(84)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	2 900	(5)	10	5	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2027	1 100	(217)	59	(158)	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement argentin	5,000	20/12/2023	6 800	(985)	140	(845)	(0,02)
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/06/2024	4 500	12	22	34	0,00
	Obligation internationale du gouvernement hongrois	1,000	20/12/2023	5 300	(38)	45	7	0,00
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/12/2027	2 200	(44)	27	(17)	0,00
	QNB Finance Ltd.	1,000	20/06/2023	3 600	28	(18)	10	0,00
	Obligation internationale du gouvernement roumain	1,000	20/12/2023	1 000	(8)	7	(1)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/12/2024	15 687	(277)	470	193	0,01
CBK	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2026	5 000	(237)	51	(186)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2024	3 300	8	22	30	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2023	5 800	(2)	(5)	(7)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2024	500	(5)	2	(3)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2026	6 000	11	(19)	(8)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement panaméen	1,000	20/06/2024	3 400	6	18	24	0,00
	Obligation internationale du gouvernement panaméen	1,000	20/12/2024	5 900	0	50	50	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	2 200	19	(12)	7	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/12/2024	1 200	(41)	56	15	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2027	2 600	(516)	142	(374)	(0,01)
DUB	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/06/2024	10 000	(131)	112	(19)	0,00
FBF	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	1 400	(68)	35	(33)	0,00
GLM	Obligation internationale du gouvernement roumain	1,000	20/12/2023	800	(3)	2	(1)	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2026	600	(32)	16	(16)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2026	3 600	33	(15)	18	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2023	2 700	(40)	37	(3)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement indonésien	1,000	20/12/2027	70 500	(1 367)	1 394	27	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2023	1 000	1	4	5	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	100	(1)	2	1	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2027	3 900	(164)	113	(51)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	29 100	118	(21)	97	0,00
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/12/2023	2 100	7	1	8	0,00

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2024	$ 3 000	$ 29	$ 0	$ 29	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/12/2024	3 413	36	6	42	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2027	7 200	(1 405)	371	(1 034)	(0,03)
HUS	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2023	400	(6)	8	2	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2024	100	(1)	2	1	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2024	9 700	103	(9)	94	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement argentin	5,000	20/12/2023	4 700	(703)	119	(584)	(0,02)
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2026	7 700	41	(2)	39	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/06/2027	10 000	(178)	185	7	0,00
	Obligation internationale du gouvernement nigérian	1,000	20/06/2023	9 100	(216)	80	(136)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	1 500	13	(8)	5	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2024	11 100	140	(32)	108	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	10 600	(171)	190	19	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	900	(48)	27	(21)	0,00
MYC	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2027	9 100	(564)	100	(464)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2023	5 100	(1)	(5)	(6)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2024	1 500	(1)	10	9	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	4 100	(15)	44	29	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2027	200	(1)	0	(1)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2027	300	(10)	6	(4)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	39 200	122	9	131	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/12/2026	3 000	(10)	12	2	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2024	18 000	98	77	175	0,01
MYI	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	2 700	23	(14)	9	0,00
					$ (8 601)	$ 4 952	$ (3 649)	(0,11)

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

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

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

SWAPS DE VOLATILITÉ

Contrepartie	Volatilité à payer/ à recevoir	Entité de référence	Taux d'exercice de volatilité	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	À payer	Volatilité réalisée au cours USD contre JPY à 1 an[1]	12,025 %	20/06/2023	$ 567	$ 0	$ 0	$ 0	0,00

(1) Swap de variance

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€	1 079	$	1 138	$ 0	$ (14)	$ (14)	0,00
	01/2023	HUF	2 538		6	0	0	0	0,00
	01/2023	$	297	HUF	134 335	60	0	60	0,00
	01/2023	ZAR	32 992	$	1 856	0	(82)	(82)	0,00
	02/2023	¥	13 480 000		92 242	0	(10 450)	(10 450)	(0,31)
	03/2023	ZAR	60 875		3 448	0	(109)	(109)	0,00
BPS	01/2023	HUF	3 341 796		8 753	0	(153)	(153)	0,00
	01/2023	$	1 209	€	1 134	2	0	2	0,00
	01/2023		796	TRY	14 998	0	0	0	0,00
	01/2023		371	ZAR	6 449	8	0	8	0,00
	03/2023	COP	3 191 768	$	660	11	0	11	0,00
	03/2023	MXN	34 745		1 724	0	(35)	(35)	0,00
	03/2023	PEN	42 770		11 001	0	(141)	(141)	0,00
	03/2023	$	20 109	MXN	399 901	162	(32)	130	0,00
	05/2023	ILS	6 916	$	2 145	171	0	171	0,01
	07/2023		61 760		19 366	1 661	0	1 661	0,05
BRC	01/2023	CNH	30 461		4 369	0	(39)	(39)	0,00
	01/2023	SGD	42		31	0	0	0	0,00
	09/2023	ZAR	347 160		19 656	0	(336)	(336)	(0,01)
CBK	01/2023	BRL	16 287		3 103	18	0	18	0,00
	01/2023	€	1 496		1 572	0	(26)	(26)	0,00
	01/2023	PEN	78 322		19 447	0	(1 046)	(1 046)	(0,03)
	01/2023	$	5 475	€	5 166	41	0	41	0,00
	01/2023	ZAR	104 510	$	5 965	0	(166)	(166)	(0,01)
	02/2023	COP	20 000 000		4 118	37	0	37	0,00
	02/2023	PEN	9 408		2 362	0	(97)	(97)	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	02/2023	$	10 054	PEN	40 097	$ 429	$ 0	$ 429	0,01
	03/2023	COP	7 815 687	$	1 623	32	0	32	0,00
	03/2023	MXN	338 796		17 269	123	0	123	0,00
	03/2023	$	498	PEN	2 003	24	0	24	0,00
	05/2023	ILS	156 657	$	46 697	1 978	0	1 978	0,06
	05/2023	PEN	6 254		1 582	0	(41)	(41)	0,00
	07/2023	ILS	113 145		35 324	2 887	0	2 887	0,09
	08/2023		190 199		58 940	4 319	0	4 319	0,13
	11/2023		106 261		32 205	1 468	0	1 468	0,04
	11/2023	$	2 209	EGP	71 296	196	0	196	0,01
CLY	01/2023	HUF	3 688 572	$	9 377	0	(454)	(454)	(0,01)
DUB	11/2023	EGP	98 621		3 471	145	0	145	0,00
GLM	01/2023	CNH	31 618		4 545	0	(30)	(30)	0,00
	01/2023	HUF	2 931 205		7 508	0	(304)	(304)	(0,01)
	01/2023	$	3 056	BRL	16 287	29	0	29	0,00
	01/2023		178	HUF	68 734	4	0	4	0,00
	01/2023		77	MYR	340	0	0	0	0,00
	01/2023		181	PLN	915	28	0	28	0,00
	03/2023	MXN	52 589	$	2 558	0	(103)	(103)	0,00
	04/2023	BRL	16 287		3 002	0	(29)	(29)	0,00
	04/2023	DOP	123 735		2 249	90	0	90	0,00
	07/2023	ILS	23 207		6 893	229	0	229	0,01
	11/2023	EGP	32 430		1 150	56	0	56	0,00
	11/2023	$	2 849	EGP	86 895	82	0	82	0,00
JPM	01/2023	£	17 365	$	20 968	77	0	77	0,00
	01/2023	$	18	CNY	123	0	0	0	0,00
	01/2023		7 824	TRY	148 957	40	0	40	0,00
	03/2023		32	CNY	219	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	€	229 261	$	240 306	0	(4 477)	(4 477)	(0,13)
	01/2023	¥	384 100		2 835	0	(78)	(78)	0,00
	01/2023	$	1 661	€	1 559	3	0	3	0,00
	01/2023		1 103	¥	145 000	0	(3)	(3)	0,00
	03/2023		17 368	PEN	66 997	85	0	85	0,00
MYI	01/2023	€	31	$	33	0	0	0	0,00
	01/2023	£	4		5	0	0	0	0,00
	01/2023	SGD	292		217	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	148	€	138	0	0	0	0,00
	01/2023		359	£	298	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		364	SGD	489	1	0	1	0,00
	11/2023	EGP	28 556	$	1 012	49	0	49	0,00
SCX	01/2023	ZMW	47 878		2 654	8	0	8	0,00
	03/2023	AED	36 512		9 941	0	0	0	0,00
	04/2023	ZAR	159 840		8 689	0	(627)	(627)	(0,02)
SOG	01/2023		15 664		883	0	(37)	(37)	0,00
TOR	01/2023		5 163		296	0	(7)	(7)	0,00
UAG	01/2023	£	3 787		4 656	100	0	100	0,00
	01/2023	HUF	3 267 027		8 514	0	(193)	(193)	(0,01)
	01/2023	TRY	145 865		7 285	0	(416)	(416)	(0,01)
	03/2023	ZAR	62 223		3 481	0	(150)	(150)	0,00
	09/2023		46 533		2 654	0	(26)	(26)	0,00
						$ 14 653	$ (19 703)	$ (5 050)	(0,14)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie M Détail en AUD (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$	240	AUD	356	$ 2	$ 0	$ 2	0,00
BOA	01/2023	AUD	5	$	4	0	0	0	0,00
CBK	01/2023		5		4	0	0	0	0,00
	01/2023	$	9	AUD	13	0	0	0	0,00
MBC	01/2023		145		215	1	0	1	0,00
MYI	01/2023		304		452	3	0	3	0,00
RBC	01/2023		51		75	1	0	1	0,00
TOR	01/2023		275		408	1	0	1	0,00
						$ 8	$ 0	$ 8	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	30 036	CHF	28 397	$ 676	$ 0	$ 676	0,02
CBK	01/2023		52 976		50 044	1 149	0	1 149	0,03
MBC	01/2023	CHF	918	$	995	2	0	2	0,00
MYI	01/2023	$	547	CHF	517	12	0	12	0,00
SCX	01/2023	CHF	600	$	648	0	(1)	(1)	0,00
						$ 1 839	$ (1)	$ 1 838	0,05

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 838	€ 795	$ 10	$ 0	$ 10	0,00
BPS	01/2023	€ 1 112	$ 1 187	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 160	€ 150	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	€ 45 056	$ 47 682	0	(424)	(424)	(0,01)
	01/2023	$ 375 471	€ 360 342	9 269	0	9 269	0,28
JPM	01/2023	9 677	9 306	259	0	259	0,01
MBC	01/2023	€ 16 955	$ 17 978	1	(126)	(125)	(0,01)
	01/2023	$ 415 977	€ 396 926	7 823	0	7 823	0,24
RYL	01/2023	189 045	178 345	1 375	0	1 375	0,04
SCX	01/2023	356 790	342 787	9 206	0	9 206	0,28
				$ 27 943	$ (551)	$ 27 392	0,83

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 275	$ 336	$ 5	$ 0	$ 5	0,00
	01/2023	$ 527	£ 438	0	0	0	0,00
BPS	01/2023	£ 13	$ 16	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	298	358	0	0	0	0,00
JPM	01/2023	$ 21 317	£ 17 653	0	(78)	(78)	0,00
MBC	01/2023	£ 578	$ 705	9	0	9	0,00
	01/2023	$ 20 993	£ 17 484	80	(38)	42	0,00
MYI	01/2023	£ 486	$ 593	8	0	8	0,00
	01/2023	$ 466	£ 379	0	(10)	(10)	0,00
TOR	01/2023	21 272	17 693	14	0	14	0,00
UAG	01/2023	£ 89	$ 110	3	0	3	0,00
				$ 119	$ (126)	$ (7)	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de capitalisation et E en SGD (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$ 18	SGD 25	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BOA	01/2023	9 230	12 668	216	0	216	0,01
BPS	01/2023	10 500	14 387	229	0	229	0,01
BRC	01/2023	869	1 174	7	0	7	0,00
GLM	01/2023	SGD 435	$ 318	0	(6)	(6)	(0,01)
	01/2023	$ 160	SGD 216	1	0	1	0,00
MBC	01/2023	SGD 292	$ 218	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 9 679	SGD 13 235	190	0	190	0,01
RBC	01/2023	39	53	0	0	0	0,00
RYL	01/2023	SGD 14	$ 11	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	$ 46	SGD 62	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	SGD 104	$ 75	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$ 471	SGD 639	6	0	6	0,00
				$ 649	$ (8)	$ 641	0,02

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ 23 986**	**0,73**

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CERTIFICATS DE DÉPÔT				
Bancolombia S.A.				
2,860 % éch. 25/02/2024	COP	8 150 000	$ 1 568	0,05
12,021 % éch. 04/08/2023		3 260 000	659	0,02
Total des Certificats de dépôt			**$ 2 227**	**0,07**
Total des Investissements			**$ 3 351 611**	**101,38**
Autres actifs et passifs à court terme			**$ (45 632)**	**(1,38)**
Actif net			**$ 3 305 979**	**100,00**

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à rémunération en nature.

(b) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

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

(f) Affilié au Fonds.

(g) Titre convertible conditionnel.

(h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 1,30 %) :

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10/06/2071	10/06/2022	$ 0	$ 0	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. « B »	10/06/2022	460	460	0,01
Banque de développement d'Afrique du Sud 8,600 % échéance 21/10/2024	07/10/2021	31 381	27 043	0,82
JPMorgan Structured Products BV 12,000 % échéance 04/01/2027	15/06/2021	1 317	1 793	0,05
JPMorgan Structured Products BV 14,000 % échéance 09/12/2031	01/06/2021	366	429	0,01
		$ 33 524	$ 29 725	0,89

(i) Des titres d'une juste valeur globale de 84 485 $ (31 décembre 2021 : 172 925 $) et montant en numéraire de 842 $ (31 décembre 2021 : 1 060 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 3 002 $ (31 décembre 2021 : 408 $) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 36 243 $ (31 décembre 2021 : 21 705 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Des titres d'une valeur de 0 $ (31 décembre 2021 : 6 297 $) et un montant en numéraire de 11 680 $ (31 décembre 2021 : 220 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 1	$ 3 210 349	$ 57 311	$ 3 267 661
Fonds d'investissement	52 797	0	0	52 797
Contrats de mise en pension	0	9 160	0	9 160
Instruments financiers dérivés[3]	5 730	14 061	(25)	19 766
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	2 227	2 227
Totaux	**$ 58 528**	**$ 3 233 570**	**$ 59 513**	**$ 3 351 611**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 1	$ 4 225 306	$ 75 060	$ 4 300 367
Fonds d'investissement	460 982	0	0	460 982
Contrats de mise en pension	0	50 323	0	50 323
Instruments financiers dérivés[3]	3 442	8 806	(94)	12 154
Totaux	**$ 464 425**	**$ 4 284 435**	**$ 74 966**	**$ 4 823 826**

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

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

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

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	En % de l'actif net
BPS	4,370 %	14/11/2022	17/01/2023	$ (29 656)	$ (29 828)	(0,90)
	4,460	14/11/2022	17/01/2023	(6 790)	(6 831)	(0,21)
BRC	0,750	17/05/2022	TBD[1]	(3 008)	(2 992)	(0,09)
	0,750	25/05/2022	TBD[1]	(1 002)	(997)	(0,03)
	0,750	27/05/2022	TBD[1]	(2 024)	(2 008)	(0,06)
	0,750	06/07/2022	TBD[1]	(1 009)	(1 005)	(0,03)
	3,800	03/08/2022	TBD[1]	(1 510)	(1 521)	(0,04)
	7,500	05/10/2022	TBD[1]	ZAR (125 726)	(7 500)	(0,23)
MBC	1,000	05/08/2022	TBD[1]	$ (1 628)	(1 622)	(0,05)
MEI	4,340	16/12/2022	TBD[1]	(9 848)	(9 867)	(0,30)
	4,590	16/12/2022	TBD[1]	(11 162)	(11 185)	(0,34)
Total des Contrats de prise en pension					**$ (75 356)**	**(2,28)**

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

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ 2	$ 0	$ 2	$ 39	$ 0	$ 39
BOA	(9 485)	8 490	(995)	(4 389)	4 435	46
BPS	1 829	(690)	1 139	811	(580)	231
BRC	(897)	860	(37)	(1 313)	1 341	28
CBK	20 215	(19 290)	925	664	(791)	(127)
CLY	(454)	0	(454)	S/O	S/O	S/O
DUB	126	(230)	(104)	259	(50)	209
FBF	(33)	0	(33)	86	0	86
GLM	46	(120)	(74)	1 889	(1 650)	239
GST	(1 298)	1 330	32	(491)	521	30
HUS	58	(150)	(92)	876	(970)	(94)
IND	0	270	270	S/O	S/O	S/O
JPM	1 107	(1 310)	(203)	793	(820)	(27)
MBC	3 472	(2 910)	562	S/O	S/O	S/O
MYC	(27)	(60)	(87)	276	(63)	213
MYI	70	(160)	(90)	75	220	295
RBC	1	0	1	5 609	(4 480)	1 129
RYL	1 375	(1 300)	75	S/O	S/O	S/O
SCX	8 586	(8 150)	436	4 274	(2 660)	1 614
SOG	(37)	0	(37)	S/O	S/O	S/O
TOR	8	(20)	(12)	5 980	(3 740)	2 240
UAG	(678)	730	52	1 042	(760)	282

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	83,54	77,77
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	15,12	13,32
Autres valeurs mobilières	0,17	0,12
Fonds d'investissement	1,60	9,78
Contrats de mise en pension	0,28	1,07
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,01	0,09
Instruments financiers dérivés compensés	(0,14)	(0,19)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,73	0,35
Certificats de dépôt	0,07	S/O
Contrats de prise en pension	(2,28)	(3,53)

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Albanie	0,09	S/O
Angola	0,19	1,12
Argentine	1,46	2,17
Arménie	S/O	0,22
Autriche	S/O	0,05
Azerbaïdjan	1,31	0,98
Bahamas	0,36	0,26
Bahreïn	0,36	0,61
Biélorussie	0,02	0,04
Bénin	0,18	S/O
Brésil	2,04	3,15
Cameroun	0,18	0,17
Îles Caïmans	3,52	3,81
Chili	2,67	2,56
Chine	0,32	2,34
Colombie	2,78	2,07
Costa Rica	0,27	0,31
République dominicaine	2,69	1,93
Équateur	1,11	1,10
Égypte	2,10	3,67
Salvador	0,28	0,25
Éthiopie	0,06	0,05
Géorgie	0,01	S/O
Allemagne	0,33	0,37
Ghana	0,74	1,12
Guatemala	0,68	1,13
Hong Kong	0,83	0,91
Hongrie	0,96	0,24
Inde	0,30	0,84
Indonésie	4,75	5,40

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Irlande	0,73	0,45
Israël	1,74	0,53
Côte d'Ivoire	0,67	1,38
Jamaïque	0,08	0,07
Japon	0,50	S/O
Jersey, Îles Anglo-Normandes	0,71	S/O
Jordanie	0,72	0,61
Kazakhstan	1,37	0,95
Kenya	0,03	0,33
Liban	0,02	S/O
Luxembourg	0,45	1,64
Malaisie	0,33	0,60
Îles Marshall	S/O	0,01
Île Maurice	0,08	0,07
Mexique	6,66	7,28
Mongolie	0,05	0,45
Maroc	0,51	0,89
Multinationales	0,28	0,22
Namibie	0,17	0,04
Pays-Bas	0,61	0,77
Nigeria	1,62	2,65
Oman	1,73	1,57
Pakistan	0,34	0,45
Panama	1,59	1,42
Paraguay	0,35	0,18
Pérou	1,17	1,37
Philippines	0,42	1,07
Pologne	0,38	S/O
Qatar	1,66	1,18
Roumanie	1,80	1,39
Russie	0,22	1,46
Rwanda	S/O	0,05
Arabie saoudite	2,32	2,77
Sénégal	0,23	0,31
Serbie	0,69	0,23
Singapour	0,50	0,16
Afrique du Sud	4,48	4,23
Espagne	0,41	S/O
Sri Lanka	0,50	0,80
Supranationales	0,21	0,29
Suisse	0,82	S/O
Tanzanie	0,50	0,53
Thaïlande	0,10	0,14
Trinité-et-Tobago	S/O	0,01
Tunisie	0,28	0,07
Turquie	5,16	4,68
Ukraine	0,27	2,65
Émirats arabes unis	1,89	1,01
Royaume-Uni	2,07	1,00
États-Unis	9,86	3,49
Uruguay	S/O	0,00
Ouzbékistan	0,21	S/O
Venezuela	0,40	0,22
Vietnam	0,02	0,01
Îles Vierges britanniques	0,64	0,62
Zambie	0,11	0,18
Instruments à court terme	9,58	1,86
Fonds d'investissement	1,60	9,78
Contrats de mise en pension	0,28	1,07
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,01	0,09
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	0,00	S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	(0,02)	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(0,12)	(0,19)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	0,08	0,04
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,11)	(0,13)
Swaps de volatilité	0,00	S/O
Contrats de change à terme	(0,14)	(0,01)
Contrats de change à terme couverts	0,90	0,45
Certificats de dépôt	0,07	S/O
Autres actifs et passifs à court terme	(1,38)	(2,31)
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
ARGENTINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement argentin				
0,500 % éch. 09/07/2030	$	13 962	$ 3 812	0,15
1,000 % éch. 09/07/2029		7 494	2 005	0,08
1,500 % éch. 09/07/2035		23 879	6 077	0,25
3,500 % éch. 09/07/2041		109 829	31 493	1,26
3,875 % éch. 09/01/2038		11 113	3 538	0,14
Provincia de la Rioja				
4,750 % éch. 24/02/2028 ^		425	204	0,01
Provincia de Neuquen				
6,625 % éch. 27/04/2030 ^		320	220	0,01
Total Argentine			47 349	1,90
ARMÉNIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de la République d'Arménie				
3,600 % éch. 02/02/2031		7 700	6 158	0,25
3,950 % éch. 26/09/2029		800	667	0,02
Total Arménie			6 825	0,27
BAHAMAS				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement des Bahamas				
6,000 % éch. 21/11/2028		7 000	5 413	0,21
9,000 % éch. 16/06/2029		3 400	2 923	0,12
Total Bahamas			8 336	0,33
BAHREÏN				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement bahreïni				
4,250 % éch. 25/01/2028		15 500	14 249	0,57
5,250 % éch. 25/01/2033		3 000	2 569	0,10
5,625 % éch. 30/09/2031		5 900	5 406	0,22
6,000 % éch. 19/09/2044		1 300	1 019	0,04
Total Bahreïn			23 243	0,93
BÉNIN				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement du Bénin				
4,950 % éch. 22/01/2035	€	11 500	8 948	0,36
BERMUDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Star Energy Geothermal Darajat				
4,850 % éch. 14/10/2038	$	3 800	3 166	0,13
BRÉSIL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco BTG Pactual S.A.				
2,750 % éch. 11/01/2026		2 400	2 184	0,09
4,500 % éch. 10/01/2025		2 600	2 510	0,10
Banco do Brasil S.A.				
3,250 % éch. 30/09/2026		8 100	7 466	0,30
Brazil Minas SPE Via State of Minas Gerais				
5,333 % éch. 15/02/2028		13 566	13 260	0,53
CSN Inova Ventures				
6,750 % éch. 28/01/2028		8 500	8 129	0,33
Itau Unibanco Holding S.A.				
5,125 % éch. 13/05/2023		300	300	0,01
Natura Cosmeticos S.A.				
4,125 % éch. 03/05/2028		8 100	6 619	0,26
Rede D'or Finance SARL				
4,500 % éch. 22/01/2030		263	227	0,01
Rumo Luxembourg SARL				
5,250 % éch. 10/01/2028		4 800	4 554	0,18
Suzano Austria GmbH				
3,125 % éch. 15/01/2032		3 000	2 343	0,09
XP, Inc.				
3,250 % éch. 01/07/2026		7 400	6 660	0,27
			54 252	2,17
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement brésilien				
4,250 % éch. 07/01/2025	$	300	$ 295	0,01
4,750 % éch. 14/01/2050		23 175	16 311	0,66
5,000 % éch. 27/01/2045		5 395	4 015	0,16
			20 621	0,83
Total Brésil			74 873	3,00
ÎLES CAÏMANS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AAC Technologies Holdings, Inc.				
2,625 % éch. 02/06/2026		6 800	5 543	0,22
Alibaba Group Holding Ltd.				
2,700 % éch. 09/02/2041		5 000	3 205	0,13
Baidu, Inc.				
1,625 % éch. 23/02/2027		3 900	3 353	0,13
2,375 % éch. 23/08/2031 (f)		3 900	3 065	0,12
Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.				
0,000 % éch. 05/06/2034 (a)		4 932	3 410	0,14
CIFI Holdings Group Co. Ltd.				
4,450 % éch. 17/08/2026 ^		2 900	767	0,03
Country Garden Holdings Co. Ltd.				
2,700 % éch. 12/07/2026		3 300	1 889	0,08
3,875 % éch. 22/10/2030		1 800	957	0,04
Hongkong Land Finance Cayman Islands Co. Ltd.				
2,250 % éch. 15/07/2031		13 000	10 205	0,41
ICD Funding Ltd.				
3,223 % éch. 28/04/2026		400	371	0,01
Interoceanica Finance Ltd.				
0,000 % éch. 30/11/2025 (a)		438	360	0,01
7,860 % éch. 15/05/2030		2 795	2 789	0,11
Kaisa Group Holdings Ltd.				
9,375 % éch. 30/06/2024 ^		1 850	260	0,01
9,750 % éch. 28/09/2023 ^		300	42	0,00
11,250 % éch. 09/04/2022 ^		1 000	129	0,01
11,500 % éch. 30/01/2023 ^		200	28	0,00
11,650 % éch. 01/06/2026 ^		3 600	507	0,02
11,700 % éch. 11/11/2025 ^		1 450	204	0,01
11,950 % éch. 12/11/2023 ^		300	42	0,00
Lima Metro Line Finance Ltd.				
5,875 % éch. 05/07/2034		473	460	0,02
MAF Sukuk Ltd.				
4,638 % éch. 14/05/2029		3 600	3 512	0,14
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.				
5,950 % éch. 30/04/2025		3 400	1 006	0,04
QNB Finance Ltd.				
3,500 % éch. 28/03/2024		300	294	0,01
Sunac China Holdings Ltd.				
5,950 % éch. 26/04/2024 ^		1 500	329	0,01
6,500 % éch. 10/01/2025 ^		700	153	0,01
7,000 % éch. 09/07/2025 ^		3 500	765	0,03
Xiaomi Best Time International Ltd.				
4,100 % éch. 14/07/2051		11 900	6 922	0,28
Zhongsheng Group Holdings Ltd.				
3,000 % éch. 13/01/2026		1 000	895	0,04
Total îles Caïman			51 462	2,06
CHILI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Santander Chile				
2,700 % éch. 10/01/2025		2 250	2 138	0,09
Corp. Nacional del Cobre de Chile				
3,150 % éch. 14/01/2030		1 050	929	0,04
3,625 % éch. 01/08/2027		600	563	0,02
3,700 % éch. 30/01/2050		700	524	0,02
4,375 % éch. 05/02/2049		200	169	0,01
4,500 % éch. 01/08/2047		500	426	0,02
4,875 % éch. 04/11/2044		300	274	0,01
Empresa de los Ferrocarriles del Estado				
3,068 % éch. 18/08/2050		600	377	0,02
3,830 % éch. 14/09/2061		2 300	1 589	0,06
Sociedad Quimica y Minera de Chile S.A.				
3,500 % éch. 10/09/2051		13 700	10 102	0,40
4,250 % éch. 07/05/2029		1 600	1 539	0,06
			18 630	0,75
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement chilien				
2,550 % éch. 27/01/2032	$	4 000	$ 3 283	0,13
2,750 % éch. 31/01/2027		12 900	11 886	0,48
3,100 % éch. 07/05/2041		15 400	11 116	0,45
3,100 % éch. 22/01/2061		7 900	4 948	0,20
3,250 % éch. 21/09/2071		4 800	2 973	0,12
3,500 % éch. 25/01/2050		5 600	4 059	0,16
3,500 % éch. 15/04/2053		8 900	6 348	0,25
4,340 % éch. 07/03/2042		7 700	6 535	0,26
			51 148	2,05
Total Chili			69 778	2,80
CHINE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Yango Justice International Ltd.				
7,500 % éch. 17/02/2025 ^		3 300	121	0,01
7,875 % éch. 04/09/2024 ^		2 000	73	0,00
Total Chine			194	0,01
COLOMBIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Davivienda S.A.				
6,650 % éch. 22/04/2031 (c)(d)		6 720	5 191	0,21
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement colombien				
2,625 % éch. 15/03/2023		1 700	1 692	0,07
3,000 % éch. 30/01/2030		300	230	0,01
3,125 % éch. 15/04/2031		6 400	4 773	0,19
3,875 % éch. 25/04/2027		4 000	3 554	0,14
3,875 % éch. 15/02/2061		9 700	5 423	0,22
4,000 % éch. 26/02/2024		5 000	4 906	0,20
4,125 % éch. 15/05/2051 (f)		18 300	11 014	0,44
5,000 % éch. 15/06/2045		1 100	753	0,03
5,200 % éch. 15/05/2049		7 700	5 273	0,21
5,625 % éch. 26/02/2044		1 000	738	0,03
6,125 % éch. 18/01/2041		11 400	9 106	0,36
8,000 % éch. 20/04/2033		10 000	10 043	0,40
10,375 % éch. 28/01/2033		1 350	1 493	0,06
			58 998	2,36
Total Colombie			64 189	2,57
COSTA RICA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement costaricain				
4,250 % éch. 26/01/2023		10 080	10 056	0,40
5,625 % éch. 30/04/2043		18 950	15 593	0,63
7,158 % éch. 12/03/2045 (f)		2 400	2 304	0,09
Total Costa Rica			27 953	1,12
CHYPRE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Atrium Finance PLC				
2,625 % éch. 05/09/2027	€	8 000	5 985	0,24
RÉPUBLIQUE DOMINICAINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Billets de la Banque centrale de la République dominicaine				
12,000 % éch. 03/10/2025	DOP	97 500	1 669	0,07
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine				
4,500 % éch. 30/01/2030	$	3 000	2 565	0,10
5,300 % éch. 21/01/2041		8 800	6 823	0,27
5,500 % éch. 27/01/2025		2 500	2 484	0,10
5,500 % éch. 22/02/2029		12 400	11 456	0,46
5,875 % éch. 30/01/2060		37 800	27 865	1,12
5,950 % éch. 25/01/2027		8 400	8 249	0,33
6,000 % éch. 19/07/2028		1 520	1 470	0,06
6,000 % éch. 22/02/2033		1 700	1 540	0,06
6,400 % éch. 05/06/2049		2 500	2 031	0,08
6,500 % éch. 15/02/2048		200	166	0,01
6,850 % éch. 27/01/2045		3 100	2 703	0,11
6,875 % éch. 29/01/2026		4 500	4 552	0,18
Total République dominicaine			73 573	2,95

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÉQUATEUR				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Ecuador Social Bond SARL				
0,000 % éch. 30/01/2035 (a)	$	11 874	$ 9 826	0,39
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement d'Équateur				
0,000 % éch. 31/07/2030 (a)		6 616	2 597	0,10
1,500 % éch. 31/07/2040		7 027	2 882	0,12
2,500 % éch. 31/07/2035		64 400	29 795	1,20
5,500 % éch. 31/07/2030		14 834	9 522	0,38
			44 796	1,80
Total Équateur			54 622	2,19
ÉGYPTE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement égyptien				
5,250 % éch. 06/10/2025		18 100	16 298	0,65
5,625 % éch. 16/04/2030	€	1 100	819	0,03
5,875 % éch. 16/02/2031	$	3 800	2 656	0,11
6,375 % éch. 11/04/2031	€	5 600	4 170	0,17
7,053 % éch. 15/01/2032	$	6 200	4 553	0,18
7,300 % éch. 30/09/2033		5 400	3 847	0,16
7,500 % éch. 16/02/2061		8 400	5 216	0,21
7,625 % éch. 29/05/2032		6 000	4 461	0,18
7,903 % éch. 21/02/2048		5 700	3 622	0,15
8,150 % éch. 20/11/2059		3 500	2 301	0,09
8,500 % éch. 31/01/2047		3 400	2 277	0,09
8,700 % éch. 01/03/2049		2 300	1 542	0,06
8,750 % éch. 30/09/2051		7 400	4 997	0,20
Total Égypte			56 759	2,28
SALVADOR				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement salvadorien				
6,375 % éch. 18/01/2027		3 600	1 611	0,06
7,125 % éch. 20/01/2050		14 900	5 899	0,24
7,625 % éch. 21/09/2034		1 100	440	0,02
7,625 % éch. 01/02/2041		250	99	0,00
7,650 % éch. 15/06/2035		1 000	407	0,02
9,500 % éch. 15/07/2052		7 750	3 467	0,14
Total Salvador			11 923	0,48
FRANCE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BNP Paribas S.A.				
7,750 % éch. 16/08/2029 (c)(d)		2 600	2 574	0,10
GÉORGIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Georgian Railway JSC				
4,000 % éch. 17/06/2028		11 000	9 735	0,39
ALLEMAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Deutsche Bank AG				
3,700 % éch. 30/05/2024		600	583	0,02
GHANA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement du Ghana				
0,000 % éch. 07/04/2025 ^		1 400	467	0,02
6,375 % éch. 11/02/2027 ^		3 000	1 163	0,05
7,625 % éch. 16/05/2029 ^		3 300	1 246	0,05
7,750 % éch. 07/04/2029 ^		2 700	1 016	0,04
7,875 % éch. 11/02/2035 ^		6 100	2 211	0,09
8,125 % éch. 26/03/2032 ^		12 500	4 586	0,18
8,625 % éch. 07/04/2034 ^		8 200	2 998	0,12
8,627 % éch. 16/06/2049 ^		1 600	566	0,02
8,750 % éch. 11/03/2061 ^		33 050	11 707	0,47
8,875 % éch. 07/05/2042 ^		1 100	396	0,02
8,950 % éch. 26/03/2051 ^		6 700	2 407	0,10
Total Ghana			28 763	1,16

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Globalworth Real Estate Investments Ltd.				
2,950 % éch. 29/07/2026	€	3 500	$ 2 975	0,12
HONG KONG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AIA Group Ltd.				
3,200 % éch. 16/09/2040	$	200	143	0,01
Fortune Star BVI Ltd.				
5,950 % éch. 19/10/2025		4 000	3 096	0,12
Huarong Finance Co. Ltd.				
3,375 % éch. 24/02/2030		3 300	2 519	0,10
3,625 % éch. 30/09/2030		2 700	2 072	0,08
3,875 % éch. 13/11/2029		900	712	0,03
4,500 % éch. 29/05/2029		1 800	1 495	0,06
4,750 % éch. 27/04/2027		800	699	0,03
4,950 % éch. 07/11/2047		1 700	1 169	0,05
5,824 % éch. 24/02/2023		1 600	1 595	0,06
Lenovo Group Ltd.				
3,421 % éch. 02/11/2030		1 500	1 192	0,05
6,536 % éch. 27/07/2032		6 800	6 593	0,26
MTR Corp. Ltd.				
1,625 % éch. 19/08/2030		6 300	5 011	0,20
			26 296	1,05
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Airport Authority Hong Kong				
2,100 % éch. 08/03/2026 (c)		1 800	1 643	0,06
2,400 % éch. 08/03/2028 (c)		3 600	3 150	0,13
2,500 % éch. 12/01/2032		200	165	0,01
Obligation internationale du gouvernement de Hong Kong				
2,375 % éch. 02/02/2051		1 200	756	0,03
			5 714	0,23
Total Hong Kong			32 010	1,28
HONGRIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement hongrois				
1,625 % éch. 28/04/2032	€	1 200	921	0,04
1,750 % éch. 05/06/2035		8 400	5 902	0,24
2,125 % éch. 22/09/2031	$	20 150	15 014	0,60
3,125 % éch. 21/09/2051		7 600	4 615	0,18
5,000 % éch. 22/02/2027	€	10 600	11 240	0,45
5,250 % éch. 16/06/2029	$	11 600	11 126	0,45
5,375 % éch. 25/03/2024		1 200	1 201	0,05
5,500 % éch. 16/06/2034		1 700	1 599	0,06
7,625 % éch. 29/03/2041		500	548	0,02
Total Hongrie			52 166	2,09
INDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Adani Renewable Energy RJ Ltd.				
4,625 % éch. 15/10/2039		3 977	3 010	0,12
Indian Railway Finance Corp. Ltd.				
3,570 % éch. 21/01/2032		11 400	9 810	0,39
3,835 % éch. 13/12/2027		3 500	3 254	0,13
JSW Hydro Energy Ltd.				
4,125 % éch. 18/05/2031		8 408	7 020	0,28
ReNew Power Pvt Ltd.				
5,875 % éch. 05/03/2027		2 000	1 922	0,08
ReNew Wind Energy AP2				
4,500 % éch. 14/07/2028		10 000	8 404	0,34
Wipro IT Services LLC				
1,500 % éch. 23/06/2026		10 000	8 774	0,35
Total Inde			42 194	1,69
INDONÉSIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Bank Mandiri Persero Tbk PT				
2,000 % éch. 19/04/2026		6 700	5 987	0,24
3,750 % éch. 11/04/2024		2 000	1 960	0,08
Pelabuhan Indonesia Persero PT				
4,250 % éch. 05/05/2025		6 700	6 477	0,26
5,375 % éch. 05/05/2045		3 000	2 765	0,11

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia				
4,700 % éch. 06/06/2032	$	18 100	$ 17 843	0,71
			35 032	1,40
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement indonésien				
1,100 % éch. 12/03/2033	€	1 700	1 333	0,05
1,300 % éch. 23/03/2034		11 400	8 836	0,36
4,750 % éch. 18/07/2047	$	4 400	4 019	0,16
5,125 % éch. 15/01/2045		4 164	4 050	0,16
5,250 % éch. 08/01/2047		200	195	0,01
7,750 % éch. 17/01/2038		3 280	3 952	0,16
8,500 % éch. 12/10/2035		1 055	1 340	0,05
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia				
3,550 % éch. 09/06/2051		5 500	4 200	0,17
3,800 % éch. 23/06/2050		3 500	2 726	0,11
			30 651	1,23
Total Indonésie			65 683	2,63
IRLANDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				
5,950 % éch. 15/04/2030 ^(d)		3 900	246	0,01
Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC				
3,949 % éch. 24/04/2023 ^		1 700	1 318	0,05
Sovcombank Via SovCom Capital DAC				
3,400 % éch. 26/01/2025 ^		5 400	436	0,02
Total Irlande			2 000	0,08
ISRAËL				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement israélien				
0,150 % éch. 31/07/2023	ILS	79 600	22 115	0,89
1,500 % éch. 30/11/2023		89 900	25 003	1,00
4,250 % éch. 31/03/2023		30 500	8 656	0,35
Total Israël			55 774	2,24
CÔTE D'IVOIRE				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
République de Côte d'Ivoire				
6,608 % éch. 19/03/2027	€	1 350	1 376	0,05
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire				
5,250 % éch. 22/03/2030		19 900	18 006	0,72
5,750 % éch. 31/12/2032	$	9 391	8 905	0,36
5,875 % éch. 17/10/2031	€	1 400	1 257	0,05
6,625 % éch. 22/03/2048		2 900	2 191	0,09
			30 359	1,22
Total Côte d'Ivoire			31 735	1,27
JAMAÏQUE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
TransJamaican Highway Ltd.				
5,750 % éch. 10/10/2036	$	667	539	0,02
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement jamaïcain				
7,875 % éch. 28/07/2045		3 300	3 725	0,15
Total Jamaïque			4 264	0,17
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Corsair International Ltd.				
5,473 % éch. 28/01/2027	€	7 900	8 368	0,34
5,823 % éch. 28/01/2029		3 400	3 592	0,14
Total Jersey, Îles Anglo-Normandes			11 960	0,48
JORDANIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement jordanien				
5,750 % éch. 31/01/2027	$	300	290	0,01
6,125 % éch. 29/01/2026		3 000	2 975	0,12
7,375 % éch. 10/10/2047		7 300	6 302	0,25
Total Jordanie			9 567	0,38

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

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
KAZAKHSTAN					
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement kazakh					
2,375 % éch. 09/11/2028	€	3 000	$	2 893	0,11
4,875 % éch. 14/10/2044	$	11 600		10 409	0,42
6,500 % éch. 21/07/2045		22 200		23 194	0,93
Total Kazakhstan				36 496	1,46
KENYA					
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement kenyan					
6,300 % éch. 23/01/2034 (f)		6 200		4 805	0,19
6,875 % éch. 24/06/2024		9 400		8 678	0,35
Total Kenya				13 483	0,54
LUXEMBOURG					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Amaggi Luxembourg International SARL					
5,250 % éch. 28/01/2028		6 000		5 663	0,23
CPI Property Group S.A.					
1,625 % éch. 23/04/2027	€	2 400		1 830	0,07
Unigel Luxembourg S.A.					
8,750 % éch. 01/10/2026	$	1 400		1 395	0,06
Total Luxembourg				8 888	0,36
MALAISIE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Axiata SPV5 Labuan Ltd.					
3,064 % éch. 19/08/2050		4 900		3 266	0,13
ÎLE MAURICE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Greenko Dutch BV					
3,850 % éch. 29/03/2026		7 067		6 148	0,25
Greenko Solar Mauritius Ltd,					
5,950 % éch. 29/07/2026		6 500		5 955	0,24
India Green Energy Holdings					
5,375 % éch. 29/04/2024		9 400		9 050	0,36
Total Île Maurice				21 153	0,85
MEXIQUE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
America Movil S.A.B. de C.V.					
5,375 % éch. 04/04/2032		6 500		5 876	0,24
Banco Mercantil del Norte S.A.					
6,625 % éch. 24/01/2032 (c)(d)		2 000		1 660	0,07
7,500 % éch. 27/06/2029 (c)(d)		3 400		3 118	0,12
7,625 % éch. 10/01/2028 (c)(d)		300		281	0,01
8,375 % éch. 14/10/2030 (c)(d)		400		397	0,02
Corp. GEO S.A.B. de C.V.					
8,875 % éch. 25/09/2014 ^		500		0	0,00
Metalsa S.A. de C.V.					
3,750 % éch. 04/05/2031		10 600		8 357	0,34
Trust Fibra Uno					
6,390 % éch. 15/01/2050		2 000		1 618	0,06
				21 307	0,86
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement mexicain					
1,350 % éch. 18/09/2027	€	600		578	0,02
2,250 % éch. 12/08/2036		9 700		7 372	0,30
2,659 % éch. 24/05/2031	$	400		324	0,01
3,750 % éch. 19/04/2071		7 200		4 500	0,18
3,771 % éch. 24/05/2061		8 200		5 209	0,21
4,875 % éch. 19/05/2033		3 000		2 760	0,11
5,750 % éch. 12/10/2110		18 340		15 499	0,62
				36 242	1,45
Total Mexique				57 549	2,31
MONGOLIE					
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement mongol					
3,500 % éch. 07/07/2027		15 800		12 760	0,51
5,125 % éch. 07/04/2026	$	1 100	$	952	0,04
5,625 % éch. 01/05/2023		2 530		2 471	0,10
Total Mongolie				16 183	0,65
MAROC					
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement marocain					
4,000 % éch. 15/12/2050		22 000		15 146	0,61
5,500 % éch. 11/12/2042		4 600		3 966	0,16
Total Maroc				19 112	0,77
MULTINATIONALES					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
NXP BV					
3,400 % éch. 01/05/2030		500		433	0,02
NAMIBIE					
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement namibien					
5,250 % éch. 29/10/2025		2 300		2 162	0,09
PAYS-BAS					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
ING Groep NV					
1,125 % éch. 07/12/2028	£	4 000		3 858	0,15
1,400 % éch. 01/07/2026	$	7 900		7 109	0,28
InterCement Financial Operations BV					
5,750 % éch. 17/07/2024		200		143	0,01
Metinvest BV					
7,750 % éch. 23/04/2023		200		162	0,01
8,500 % éch. 23/04/2026		1 100		588	0,02
NE Property BV					
2,000 % éch. 20/01/2030	€	5 600		4 150	0,17
3,375 % éch. 14/07/2027		2 300		2 130	0,09
Prosus NV					
1,539 % éch. 03/08/2028		800		694	0,03
2,031 % éch. 03/08/2032		400		304	0,01
3,257 % éch. 19/01/2027	$	2 200		1 970	0,08
4,027 % éch. 03/08/2050		800		501	0,02
Total Pays-Bas				21 609	0,87
OMAN					
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement omanais					
4,125 % éch. 17/01/2023		7 424		7 415	0,30
4,750 % éch. 15/06/2026		4 600		4 457	0,18
4,875 % éch. 01/02/2025		3 000		2 952	0,12
5,375 % éch. 08/03/2027		5 600		5 496	0,22
5,625 % éch. 17/01/2028		8 200		8 119	0,32
6,000 % éch. 01/08/2029		12 300		12 376	0,50
6,250 % éch. 25/01/2031		6 200		6 258	0,25
6,500 % éch. 08/03/2047		2 650		2 424	0,10
6,750 % éch. 28/10/2027		15 500		16 092	0,64
6,750 % éch. 17/01/2048		6 700		6 298	0,25
7,000 % éch. 25/01/2051		4 800		4 657	0,19
Total Oman				76 544	3,07
PANAMA					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Aeropuerto Internacional de Tocumen S.A.					
5,125 % éch. 11/08/2061		2 900		2 384	0,10
Banco General S.A.					
5,250 % éch. 07/05/2031 (c)		6 500		5 387	0,22
Banco Nacional de Panama					
2,500 % éch. 11/08/2030		600		482	0,02
Empresa de Transmision Electrica S.A.					
5,125 % éch. 02/05/2049		1 000		811	0,03
				9 064	0,37
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement panaméen					
2,252 % éch. 29/09/2032		3 300		2 456	0,10
3,160 % éch. 23/01/2030		800		691	0,03
3,870 % éch. 23/07/2060		8 500		5 511	0,22
4,300 % éch. 29/04/2053		1 500		1 089	0,04
4,500 % éch. 15/05/2047	$	6 000	$	4 634	0,19
4,500 % éch. 16/04/2050		9 800		7 429	0,30
4,500 % éch. 01/04/2056		15 000		10 992	0,44
4,500 % éch. 19/01/2063		18 500		13 105	0,52
6,400 % éch. 14/02/2035		7 700		7 834	0,31
6,700 % éch. 26/01/2036		6 500		6 798	0,27
8,125 % éch. 28/04/2034		1 000		1 195	0,05
9,375 % éch. 16/01/2023		180		180	0,01
				61 914	2,48
Total Panama				70 978	2,85
PARAGUAY					
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement paraguayen					
2,739 % éch. 29/01/2033		1 900		1 532	0,06
3,849 % éch. 28/06/2033		1 900		1 675	0,07
4,700 % éch. 27/03/2027		2 300		2 268	0,09
5,400 % éch. 30/03/2050		15 200		13 155	0,53
5,600 % éch. 13/03/2048		1 800		1 578	0,06
6,100 % éch. 11/08/2044		2 500		2 415	0,10
Total Paraguay				22 623	0,91
PÉROU					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Cia de Minas Buenaventura SAA					
5,500 % éch. 23/07/2026		1 400		1 202	0,05
InRetail Consumer					
3,250 % éch. 22/03/2028		3 700		3 187	0,13
				4 389	0,18
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Fondo MIVIVIENDA S.A.					
4,625 % éch. 12/04/2027		12 500		11 855	0,48
Obligation internationale du gouvernement péruvien					
1,950 % éch. 17/11/2036	€	8 300		6 125	0,25
3,000 % éch. 15/01/2034	$	3 900		3 084	0,12
3,230 % éch. 28/07/2121		1 900		1 110	0,04
3,600 % éch. 15/01/2072		6 500		4 253	0,17
6,550 % éch. 14/03/2037		2 842		3 005	0,12
				29 432	1,18
Total Pérou				33 821	1,36
PHILIPPINES					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Globe Telecom, Inc.					
4,200 % éch. 02/08/2026 (c)		6 700		6 013	0,24
PLDT, Inc.					
3,450 % éch. 23/06/2050		3 900		2 711	0,11
				8 724	0,35
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement philippin					
2,650 % éch. 10/12/2045		2 800		1 894	0,08
2,950 % éch. 05/05/2045		10 500		7 609	0,30
3,200 % éch. 06/07/2046		12 900		9 474	0,38
3,700 % éch. 01/03/2041		300		246	0,01
6,375 % éch. 23/10/2034		800		888	0,03
7,750 % éch. 14/01/2031		600		714	0,03
9,500 % éch. 02/02/2030		1 100		1 407	0,06
				22 232	0,89
Total Philippines				30 956	1,24
POLOGNE					
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement polonais					
5,500 % éch. 16/11/2027		9 800		10 087	0,40
QATAR					
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement qatari					
3,250 % éch. 02/06/2026		7 000		6 754	0,27
4,400 % éch. 16/04/2050		21 100		19 365	0,78
4,500 % éch. 23/04/2028		7 000		7 057	0,28
4,817 % éch. 14/03/2049		11 365		11 085	0,44

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
5,103 % éch. 23/04/2048	$	1 000	$ 1 007	0,04
Total Qatar			45 268	1,81
ROUMANIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement roumain				
1,750 % éch. 13/07/2030 (f)	€	6 100	4 549	0,18
2,000 % éch. 08/12/2026		300	288	0,01
2,124 % éch. 16/07/2031 (f)		31 610	23 375	0,94
2,124 % éch. 16/07/2031		1 500	1 109	0,05
2,125 % éch. 07/03/2028		4 600	4 109	0,17
2,625 % éch. 02/12/2040		3 950	2 362	0,10
2,750 % éch. 14/04/2041		7 800	4 694	0,19
2,875 % éch. 26/05/2028		100	93	0,00
2,875 % éch. 13/04/2042		8 600	5 162	0,21
3,375 % éch. 28/01/2050		6 200	3 825	0,15
3,500 % éch. 03/04/2034		3 000	2 350	0,09
3,750 % éch. 07/02/2034		950	759	0,03
4,125 % éch. 11/03/2039		1 000	765	0,03
4,625 % éch. 03/04/2049		2 200	1 705	0,07
6,125 % éch. 22/01/2044	$	1 200	1 108	0,04
Total Roumanie			56 253	2,26
RUSSIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
MMK International Capital DAC				
4,375 % éch. 13/06/2024 ^		2 800	980	0,04
SÉNÉGAL				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement sénégalais				
4,750 % éch. 13/03/2028	€	1 200	1 108	0,04
5,375 % éch. 08/06/2037		5 800	4 181	0,17
6,250 % éch. 23/05/2033	$	5 600	4 644	0,18
6,750 % éch. 13/03/2048		600	426	0,02
Total Sénégal			10 359	0,41
SERBIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement serbe				
1,000 % éch. 23/09/2028	€	6 200	4 772	0,19
1,650 % éch. 03/03/2033		14 400	9 375	0,38
3,125 % éch. 15/05/2027		7 300	6 722	0,27
Total Serbie			20 869	0,84
SINGAPOUR				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.				
4,250 % éch. 25/03/2027	$	5 348	4 648	0,19
Flex Ltd.				
4,875 % éch. 15/06/2029		200	189	0,01
United Overseas Bank Ltd.				
1,250 % éch. 14/04/2026		6 500	5 850	0,23
Total Singapour			10 687	0,43
AFRIQUE DU SUD				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banque de développement d'Afrique du Sud				
8,600 % éch. 21/10/2024 (e)	ZAR	253 300	14 659	0,59
Growthpoint Properties International Pty. Ltd.				
5,872 % éch. 02/05/2023	$	1 300	1 295	0,05
			15 954	0,64
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement sud-africain				
4,300 % éch. 12/10/2028		12 000	10 740	0,43
4,850 % éch. 27/09/2027		3 200	3 048	0,12
4,850 % éch. 30/09/2029		11 000	9 846	0,39
5,000 % éch. 12/10/2046		2 000	1 409	0,06
5,750 % éch. 30/09/2049		21 800	16 107	0,65
5,875 % éch. 20/04/2032		13 500	12 227	0,49
7,300 % éch. 20/04/2052		6 000	5 196	0,21
10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	241 200	14 986	0,60
			73 559	2,95
Total Afrique du Sud			89 513	3,59

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CORÉE DU SUD				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Hana Bank				
3,500 % éch. 19/10/2026 (c)(d)	$	6 500	$ 5 656	0,23
Hanwha Life Insurance Co. Ltd.				
3,379 % éch. 04/02/2032		6 700	5 572	0,22
Hyundai Capital Services, Inc.				
1,250 % éch. 08/02/2026		8 200	7 131	0,29
KB Kookmin Card Co. Ltd.				
1,500 % éch. 13/05/2026		10 000	8 669	0,35
4,000 % éch. 09/06/2025		7 900	7 541	0,30
Kookmin Bank				
2,500 % éch. 04/11/2030 (d)		2 500	1 995	0,08
Mirae Asset Securities Co. Ltd.				
1,375 % éch. 07/07/2024		17 600	16 386	0,66
NongHyup Bank				
1,250 % éch. 28/07/2026		13 000	11 372	0,45
Shinhan Bank Co. Ltd.				
4,375 % éch. 13/04/2032 (d)		9 000	8 041	0,32
Shinhan Card Co. Ltd.				
1,375 % éch. 19/10/2025		3 000	2 653	0,11
1,375 % éch. 23/06/2026		3 000	2 588	0,10
Shinhan Financial Group Co. Ltd.				
2,875 % éch. 12/05/2026 (c)(d)		8 000	6 878	0,27
3,340 % éch. 05/02/2030 (d)		5 100	4 675	0,19
SK Hynix, Inc.				
2,375 % éch. 19/01/2031		5 300	3 891	0,16
Woori Card Co. Ltd.				
1,750 % éch. 23/03/2026		6 000	5 312	0,21
			98 360	3,94
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Export-Import Bank of Korea				
2,125 % éch. 18/01/2032		7 200	5 766	0,23
Korea Expressway Corp.				
1,125 % éch. 17/05/2026		4 800	4 264	0,17
Korea Water Resources Corp.				
3,500 % éch. 27/04/2025		6 500	6 274	0,26
			16 304	0,66
Total Corée du Sud			114 664	4,60
ESPAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Santander S.A.				
5,147 % éch. 18/08/2025		9 600	9 503	0,38
SRI LANKA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement du Sri Lanka				
5,750 % éch. 18/04/2023 ^		6 900	2 190	0,09
5,875 % éch. 25/07/2022 ^		1 236	408	0,01
6,125 % éch. 03/06/2025 ^		3 700	1 211	0,05
6,200 % éch. 11/05/2027 ^		7 100	2 266	0,09
6,750 % éch. 18/04/2028 ^		6 800	2 178	0,09
6,825 % éch. 18/07/2026 ^		3 800	1 217	0,05
6,850 % éch. 14/03/2024 ^		900	287	0,01
6,850 % éch. 03/11/2025 ^		3 000	968	0,04
7,550 % éch. 28/03/2030 ^		17 400	5 552	0,22
7,850 % éch. 14/03/2029 ^		1 600	512	0,02
Total Sri Lanka			16 789	0,67
SUPRANATIONALES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
African Export-Import Bank				
2,634 % éch. 17/05/2026		5 500	4 936	0,20
Banque de développement asiatique				
4,700 % éch. 12/03/2024	MXN	89 800	4 240	0,17
6,550 % éch. 26/01/2025	ZAR	118 000	6 759	0,27

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Banque Ouest Africaine de Développement				
2,750 % éch. 22/01/2033	€	5 400	$ 4 381	0,17
5,000 % éch. 27/07/2027	$	800	755	0,03
Banque de développement et de commerce d'Afrique orientale et australe				
4,125 % éch. 30/06/2028		16 800	13 926	0,56
Banque internationale pour la reconstruction et le développement				
5,310 % éch. 05/02/2026	ZAR	114 000	6 218	0,25
Société financière internationale				
8,000 % éch. 09/10/2023	IDR	57 500 000	3 758	0,15
			44 973	1,80
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement du Ghana				
10,750 % éch. 14/10/2030 ^	$	200	141	0,01
Total Supranationales			45 114	1,81
SUISSE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Credit Suisse AG				
4,750 % éch. 09/08/2024		4 100	3 917	0,16
Credit Suisse Group AG				
6,373 % éch. 15/07/2026		3 200	3 007	0,12
9,750 % éch. 23/06/2027 (c)(d)		2 100	1 835	0,07
UBS Group AG				
4,490 % éch. 05/08/2025		4 200	4 130	0,17
4,988 % éch. 05/08/2033		1 700	1 579	0,06
Total Suisse			14 468	0,58
TANZANIE				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Ministère des Finances et de la Planification, Gouvernement de la République unie de Tanzanie				
7,737 % éch. 26/04/2028	€	5 800	6 107	0,24
TUNISIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de la Banque centrale de Tunisie				
5,625 % éch. 17/02/2024		4 300	3 625	0,15
5,750 % éch. 30/01/2025 (f)	$	1 400	975	0,04
6,375 % éch. 15/07/2026	€	900	609	0,02
6,750 % éch. 31/10/2023		3 701	3 330	0,13
Total Tunisie			8 539	0,34
TURQUIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Akbank T.A.S.				
6,800 % éch. 22/06/2031 (d)	$	6 500	5 869	0,23
Turkish Airlines Pass-Through Trust				
4,200 % éch. 15/09/2028		222	194	0,01
			6 063	0,24
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Export-Credit Bank of Turkey				
5,750 % éch. 06/07/2026		11 000	10 038	0,40
8,250 % éch. 24/01/2024		1 500	1 523	0,06
Obligation internationale du gouvernement turc				
4,250 % éch. 13/03/2025		1 000	937	0,04
4,875 % éch. 16/04/2043		8 200	5 360	0,21
5,125 % éch. 17/02/2028		2 500	2 172	0,09
5,750 % éch. 11/05/2047		24 700	16 920	0,68
5,875 % éch. 26/06/2031		2 400	1 976	0,08
5,950 % éch. 15/01/2031		2 000	1 661	0,07
6,000 % éch. 25/03/2027		300	275	0,01
6,000 % éch. 14/01/2041		600	437	0,02
6,375 % éch. 14/10/2025		2 000	1 924	0,08
6,875 % éch. 17/03/2036		3 130	2 630	0,10
			45 853	1,84
Total Turquie			51 916	2,08

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

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
UKRAINE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
NPC Ukrenergo				
6,875 % éch. 09/11/2028 ^	$	8 100	$ 1 441	0,06
State Agency of Roads of Ukraine				
6,250 % éch. 24/06/2030 ^		7 900	1 434	0,05
			2 875	0,11
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement ukrainien				
4,375 % éch. 27/01/2032 ^	€	2 700	537	0,02
6,876 % éch. 21/05/2031 ^	$	8 300	1 662	0,07
7,253 % éch. 15/03/2035 ^		25 900	5 181	0,21
7,375 % éch. 25/09/2034 ^		5 900	1 136	0,04
7,750 % éch. 01/09/2024 ^		3 900	981	0,04
7,750 % éch. 01/09/2025 ^		6 800	1 571	0,06
7,750 % éch. 01/09/2026 ^		12 300	2 683	0,11
7,750 % éch. 01/09/2027 ^		9 000	1 955	0,08
7,750 % éch. 01/09/2028 ^		100	22	0,00
8,994 % éch. 01/02/2026 ^		4 300	974	0,04
			16 702	0,67
Total Ukraine			19 577	0,78
ÉMIRATS ARABES UNIS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
MDGH GMTN RSC Ltd.				
3,700 % éch. 07/11/2049		3 000	2 486	0,10
3,950 % éch. 21/05/2050		800	700	0,03
Sweihan PV Power Co. PJSC				
3,625 % éch. 31/01/2049		5 065	4 085	0,16
			7 271	0,29
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
NMC OpCo Ltd.				
10,358 % éch. 25/03/2027	AED	25 528	6 881	0,27
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi				
3,125 % éch. 30/09/2049	$	800	594	0,02
3,875 % éch. 16/04/2050		5 400	4 594	0,19
Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat de Dubaï				
3,900 % éch. 09/09/2050		700	504	0,02
Département des finances du gouvernement de Sharjah				
4,000 % éch. 28/07/2050		4 800	3 162	0,13
4,375 % éch. 10/03/2051		3 000	2 029	0,08
			10 883	0,44
Total Émirats arabes unis			25 035	1,00
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Barclays PLC				
5,304 % éch. 09/08/2026		6 000	5 961	0,24
5,746 % éch. 09/08/2033		1 000	948	0,04
HSBC Holdings PLC				
3,803 % éch. 11/03/2025		300	292	0,01
5,210 % éch. 11/08/2028		2 500	2 416	0,10
5,402 % éch. 11/08/2033		1 000	929	0,04
6,000 % éch. 22/05/2027 (c)(d)		800	736	0,03
Lloyds Banking Group PLC				
4,716 % éch. 11/08/2026		2 600	2 547	0,10
4,976 % éch. 11/08/2033		3 000	2 763	0,11
NatWest Group PLC				
4,269 % éch. 22/03/2025		200	196	0,01
5,076 % éch. 27/01/2030		300	283	0,01
Standard Chartered PLC				
7,767 % éch. 16/11/2028		7 600	8 065	0,32
State Savings Bank of Ukraine Via SSB PLC				
9,375 % éch. 10/03/2023		224	162	0,01
Ukraine Railways Via Rail Capital Markets PLC				
7,875 % éch. 15/07/2026		6 500	1 209	0,05
8,250 % éch. 09/07/2024		3 100	668	0,02
Ukreximbank Via Biz Finance PLC				
9,750 % éch. 22/01/2025		813	276	0,01
			27 451	1,10

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Canada Square Funding PLC				
3,735 % éch. 17/01/2059	£	2 095	$ 2 423	0,10
Polaris PLC				
4,682 % éch. 27/05/2057		350	419	0,02
RMAC PLC				
4,206 % éch. 12/06/2046		1 619	1 938	0,08
Rochester Financing PLC				
4,126 % éch. 18/12/2044		2 227	2 583	0,10
Stratton Mortgage Funding PLC				
4,287 % éch. 12/03/2052		558	669	0,03
Towd Point Mortgage Funding PLC				
4,171 % éch. 20/05/2045		943	1 117	0,04
4,471 % éch. 20/02/2054		2 317	2 776	0,11
Tower Bridge Funding PLC				
4,151 % éch. 20/12/2063		1 568	1 839	0,07
			13 764	0,55
Total Royaume-Uni			41 215	1,65
ÉTATS-UNIS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,869 % éch. 25/02/2037	$	749	718	0,03
5,514 % éch. 25/11/2035		640	616	0,03
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				
3,103 % éch. 25/01/2037 ^		2 363	756	0,03
Long Beach Mortgage Loan Trust				
4,689 % éch. 25/09/2036		821	524	0,02
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
4,829 % éch. 25/11/2036		909	555	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,184 % éch. 25/03/2034		788	760	0,03
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				
4,539 % éch. 25/07/2036		179	161	0,01
Option One Mortgage Loan Trust				
4,609 % éch. 25/05/2037		237	145	0,01
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,169 % éch. 25/09/2035		1 000	835	0,03
Saxon Asset Securities Trust				
4,699 % éch. 25/09/2037		48	45	0,00
Soundview Home Loan Trust				
4,569 % éch. 25/02/2037		197	57	0,00
5,289 % éch. 25/10/2037		127	99	0,00
			5 271	0,21
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Alphabet, Inc.				
2,250 % éch. 15/08/2060		4 100	2 330	0,10
Bank of America Corp.				
0,981 % éch. 25/09/2025		8 700	8 013	0,32
Ford Motor Co.				
3,250 % éch. 12/02/2032		12 000	9 021	0,37
JPMorgan Chase & Co.				
0,653 % éch. 16/09/2024		2 600	2 508	0,10
JPMorgan Structured Products BV				
12,000 % éch. 04/01/2027 (e)	ZMW	26 300	1 003	0,04
14,000 % éch. 09/12/2031 (e)		8 200	246	0,01
Morgan Stanley				
0,864 % éch. 21/10/2025	$	2 500	2 295	0,09
Pricoa Global Funding				
4,200 % éch. 28/08/2025		450	441	0,02
Rutas 2 and 7 Finance Ltd.				
0,000 % éch. 30/09/2036 (a)		4 853	3 067	0,12
Santander Holdings USA, Inc.				
5,807 % éch. 09/09/2026		12 000	11 922	0,49
			40 846	1,66
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
CitiMortgage Alternative Loan Trust				
5,039 % éch. 25/10/2036		80	68	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust				
4,739 % éch. 25/05/2036 ^		121	53	0,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates			
3,276 % éch. 30/11/2037	600	549	0,02
IndyMac Mortgage Loan Trust			
3,141 % éch. 25/11/2037	$ 217	$ 177	0,01
4,749 % éch. 25/02/2037	262	248	0,01
5,029 % éch. 25/07/2045	57	47	0,00
JPMorgan Resecuritization Trust			
2,500 % éch. 25/03/2056	36	34	0,00
Lehman XS Trust			
4,769 % éch. 25/09/2046	231	193	0,01
4,889 % éch. 25/08/2037	847	758	0,03
Structured Asset Mortgage Investments Trust			
4,539 % éch. 25/02/2037	410	360	0,02
SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
3,691 % éch. 25/10/2037 ^	65	56	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
3,122 % éch. 25/03/2036	195	175	0,01
		2 718	0,11
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
2,500 % éch. 01/01/2053	650	551	0,02
3,500 % éch. 01/02/2053	2 600	2 364	0,10
		2 915	0,12
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Obligations du Trésor américain			
2,375 % éch. 15/02/2042	8 600	6 570	0,26
3,250 % éch. 15/05/2042	66 400	58 246	2,34
3,375 % éch. 15/08/2042	25 500	22 799	0,91
Billets du Trésor américain			
3,125 % éch. 31/08/2029	37 800	35 890	1,45
		123 505	4,96
Total États-Unis		175 255	7,06
URUGUAY			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement uruguayen			
4,975 % éch. 20/04/2055	15 300	14 675	0,59
5,100 % éch. 18/06/2050	14 418	14 189	0,57
7,625 % éch. 21/03/2036	2 880	3 652	0,14
7,875 % éch. 15/01/2033	6 930	8 660	0,35
Total Uruguay		41 176	1,65
OUZBÉKISTAN			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement ouzbek			
5,375 % éch. 20/02/2029	800	744	0,03
VIETNAM			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement vietnamien			
4,800 % éch. 19/11/2024	1 000	989	0,04
ÎLES VIERGES BRITANNIQUES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
1MDB Global Investments Ltd.			
4,400 % éch. 09/03/2023	12 200	11 945	0,48
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.			
5,125 % éch. 15/05/2024	300	297	0,01
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.			
6,750 % éch. 24/04/2033	6 243	5 913	0,24
Total Îles Vierges britanniques		18 155	0,73
ZAMBIE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement zambien			
5,375 % éch. 20/09/2022 ^	1 200	505	0,02
8,500 % éch. 14/04/2024 ^	4 400	2 021	0,08
8,970 % éch. 30/07/2027 ^	900	405	0,02
Total Zambie		2 931	0,12
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BILLETS DE TRÉSORERIE			
CNH Industrial Capital LLC			
4,950 % éch. 21/02/2023	900	893	0,04

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Électricité de France S.A.				
5,000 % éch. 20/01/2023	$	15 900	$ 15 857	0,63
Fiserv, Inc.				
4,780 % éch. 23/01/2023		5 500	5 483	0,22
4,820 % éch. 01/02/2023		2 400	2 390	0,10
Humana, Inc.				
4,850 % éch. 10/01/2023		1 500	1 498	0,06
Mondelez International, Inc.				
4,670 % éch. 11/01/2023		600	599	0,02
Oracle Corp.				
4,760 % éch. 27/01/2023		3 000	2 989	0,12
4,800 % éch. 26/01/2023		2 200	2 192	0,09
Walgreens Boots Alliance, Inc.				
4,900 % éch. 11/01/2023		9 400	9 386	0,38
4,950 % éch. 18/01/2023		9 300	9 277	0,37
			50 564	2,03
BONS DU TRÉSOR HONGROIS				
18,250 % éch. 03/01/2023 (a)(b)	HUF	9 822 000	26 177	1,05
BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN				
0,531 % éch. 08/02/2023 (a)(b)	ILS	116 500	$ 32 897	1,34
1,718 % éch. 03/05/2023 (a)(b)		9 800	2 745	0,11
1,727 % éch. 05/07/2023 (a)(b)		46 100	12 823	0,51
1,734 % éch. 05/07/2023 (a)(b)		59 900	16 661	0,67
1,755 % éch. 05/07/2023 (a)(b)		60 300	16 773	0,67
1,783 % éch. 03/05/2023 (a)(b)		47 800	13 388	0,54
1,828 % éch. 02/08/2023 (a)(b)		58 800	16 312	0,65
1,837 % éch. 02/08/2023 (a)(b)		76 800	21 306	0,86
			132 905	5,35
Total des Instruments à court terme			209 646	8,43
Total des Valeurs mobilières			**$ 2 422 256**	**97,17**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
FICC	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 9 261	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 29/06/2023	$ (9 446)	$ 9 261	$ 9 262	0,37
NOM	4,320	30/12/2022	03/01/2023	35 400	Obligations du Trésor américain 3,000 % échéance 15/11/2044	(36 124)	35 400	35 417	1,42
Total des Contrats de mise en pension						**$ (45 570)**	**$ 44 661**	**$ 44 679**	**1,79**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Court	03/2023	415	$ 1 503	0,06
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	302	2 754	0,11
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	Court	03/2023	17	464	0,02
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars	Long	03/2023	416	(621)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Court	03/2023	58	1 173	0,05
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Court	03/2023	916	8	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	3 407	(3 470)	(0,14)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Long	03/2023	278	(759)	(0,03)
				$ 1 052	0,04
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ 1 052**	**0,04**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Standard Chartered PLC	(1,000) %	20/12/2027	€ 7 600	$ (101)	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[2]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AT&T, Inc.	1,000 %	20/06/2023	$ 200	$ 0	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2024	300	1	0,00
				$ 1	0,00

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000 %	21/09/2024	$ 63 400	$ 1 617	0,07
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024	68 300	(1 139)	(0,05)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,415	04/01/2027	BRL 78 000	(406)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,453	04/01/2027	44 100	(222)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,620	04/01/2027	17 700	(75)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,828	02/01/2025	68 400	(178)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,220	02/01/2025	160 300	(420)	(0,02)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,015	04/01/2027	81 200	(176)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,190	02/01/2025	28 100	(41)	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,215	02/01/2025	28 200	(43)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	13,400	02/01/2025	66 100	(135)	(0,01)
À recevoir[4]	CDI BRL à 1 an	13,400	02/01/2025	93 200	193	0,01
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,750	15/03/2028	CNY 259 722	17	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,750	15/12/2031	$ 1 800	(316)	(0,01)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	5,950	30/11/2024	ZAR 346 600	677	0,03
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,820	28/12/2027	CLP 2 459 300	3	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,700	28/12/2025	8 436 600	7	0,00
À recevoir[4]	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,700	30/12/2025	1 909 000	1	0,00
À recevoir[4]	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,757	03/01/2026	8 155 300	(17)	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	€ 13 200	345	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,470	21/04/2025	MXN 32 600	187	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,520	24/04/2025	31 000	178	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,615	23/04/2025	128 300	749	0,03
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,100	26/02/2025	126 600	(777)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,100	28/02/2025	66 100	(409)	(0,02)
					$ (380)	(0,02)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ (480)**	**(0,02)**

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

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

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

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

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

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

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

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel(3)	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement omanais	(1,000) %	20/12/2027	$ 2 200	$ 72	$ 11	$ 83	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/12/2026	4 300	714	(166)	548	0,02
BPS	Obligation internationale du gouvernement omanais	(1,000)	20/12/2027	700	23	4	27	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement omanais	(1,000)	20/12/2027	3 400	91	37	128	0,01
CBK	Obligation internationale du gouvernement chinois	(1,000)	20/06/2024	15 000	(167)	22	(145)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/12/2026	2 800	466	(110)	356	0,02
GST	Obligation internationale du gouvernement chinois	(1,000)	20/06/2024	15 000	(167)	22	(145)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/06/2027	53 000	(1 849)	782	(1 067)	(0,04)
MYC	Obligation internationale du gouvernement turc	(1,000)	20/12/2026	2 500	423	(104)	319	0,01
					$ (394)	$ 498	$ 104	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION(2)

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel(3)	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000 %	20/06/2031	$ 1 200	$ (181)	$ 11	$ (170)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/06/2024	200	1	0	1	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	18 100	13	116	129	0,01
	Obligation internationale du gouvernement du Monténégro	1,000	20/06/2023	€ 800	(62)	51	(11)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2023	$ 5 000	63	(46)	17	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	6 400	26	(5)	21	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/12/2031	11 900	(502)	(124)	(626)	(0,02)
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/06/2024	9 400	(90)	72	(18)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2025	1 200	(66)	43	(23)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2027	100	(20)	6	(14)	0,00

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000 %	20/12/2026	$ 10 400	$ (639)	$ 253	$ (386)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2027	8 200	(589)	62	(527)	(0,02)
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2023	900	2	3	5	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/06/2024	3 300	9	16	25	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2024	4 000	5	31	36	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2023	4 200	(2)	(3)	(5)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2023	500	0	3	3	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	2 100	(5)	20	15	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	6 100	54	(34)	20	0,00
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/12/2023	700	2	1	3	0,00
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/12/2027	1 300	(9)	(1)	(10)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement roumain	1,000	20/12/2023	1 400	(6)	4	(2)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement roumain	1,000	20/12/2027	700	(51)	(3)	(54)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2027	3 800	(751)	205	(546)	(0,02)
BRC	Obligation internationale du gouvernement argentin	5,000	20/12/2023	800	(96)	(3)	(99)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2030	1 400	(194)	9	(185)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/06/2024	5 800	18	26	44	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2026	2 500	14	(1)	13	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2023	1 000	0	1	1	0,00
	Obligation internationale du gouvernement hongrois	1,000	20/12/2023	4 000	(29)	34	5	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/12/2025	17 500	360	(255)	105	0,00
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/12/2027	1 700	(34)	21	(13)	0,00
	QNB Finance Ltd.	1,000	20/06/2023	900	7	(4)	3	0,00
	Obligation internationale du gouvernement roumain	1,000	20/12/2023	800	(6)	5	(1)	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2023	4 200	(1)	(4)	(5)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2024	300	(3)	1	(2)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2024	800	3	(10)	(7)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement panaméen	1,000	20/06/2024	2 300	4	13	17	0,00
	Obligation internationale du gouvernement panaméen	1,000	20/12/2024	4 300	0	36	36	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	2 100	18	(11)	7	0,00
	Obligation internationale du gouvernement qatari	1,000	20/12/2026	5 000	140	(29)	111	0,01
DUB	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/06/2024	13 800	(148)	122	(26)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2026	10 400	(638)	235	(403)	(0,02)
FBF	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	200	(10)	5	(5)	0,00
GLM	Obligation internationale du gouvernement roumain	1,000	20/12/2023	600	(2)	1	(1)	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2026	200	(11)	6	(5)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2031	1 500	(227)	15	(212)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2024	14 000	(34)	(97)	(131)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement indonésien	1,000	20/12/2027	11 200	(217)	221	4	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2023	900	1	4	5	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	13 700	99	(53)	46	0,00
	Obligation internationale du gouvernement polonais	1,000	20/12/2023	1 500	5	1	6	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/06/2024	1 000	(10)	8	(2)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2027	4 300	(840)	222	(618)	(0,02)
HUS	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2024	100	(1)	2	1	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement hongrois	1,000	20/06/2027	5 700	(290)	93	(197)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement indonésien	1,000	20/12/2024	7 400	60	25	85	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	2 500	(40)	44	4	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	700	(37)	20	(17)	0,00
MYC	Obligation internationale du gouvernement argentin	5,000	20/12/2023	1 500	(289)	103	(186)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2027	2 800	(173)	30	(143)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2030	2 900	(405)	22	(383)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2024	2 400	6	16	22	0,00
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/06/2026	15 000	208	(102)	106	0,01
	Obligation internationale du gouvernement chilien	1,000	20/12/2026	16 300	112	(29)	83	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2023	3 800	0	(4)	(4)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	4 800	19	15	34	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2027	200	(7)	4	(3)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	12 100	65	(25)	40	0,00
	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/12/2026	20 000	80	(66)	14	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2026	4 600	(206)	28	(178)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2027	1 800	(356)	97	(259)	(0,01)
MYI	Obligation internationale du gouvernement péruvien	1,000	20/06/2026	1 300	11	(7)	4	0,00
					$ (5 872)	$ 1 466	$ (4 406)	(0,18)

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

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

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

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

SWAPS DE VOLATILITÉ

Contrepartie	Volatilité à payer/à recevoir	Entité de référence	Taux d'exercice de volatilité	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	À payer	Volatilité réalisée au cours USD contre JPY à 1 an[1]	12,025 %	20/06/2023	$ 418	$ 0	$ 0	$ 0	0,00

[1] Swap de variance

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	HUF	1 501 443	$	3 833	$ 0	$ (168)	$ (168)	(0,01)
	01/2023	ZAR	17 887		1 006	0	(44)	(44)	0,00
	03/2023		82 110		4 650	0	(148)	(148)	(0,01)
	07/2023	ILS	34 300		9 926	77	0	77	0,00
BPS	01/2023	HUF	5 008 453		13 092	0	(256)	(256)	(0,01)
	01/2023	$	1 095	€	1 027	2	0	2	0,00
	01/2023		148	ILS	506	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	ZAR	2 338	$	135	0	(2)	(2)	0,00
	03/2023	COP	2 377 182		492	8	0	8	0,00
	03/2023	PEN	27 846		7 162	0	(92)	(92)	0,00
	03/2023	$	11 131	MXN	222 195	115	(1)	114	0,01
	05/2023	ILS	9 682	$	3 003	239	0	239	0,01
	11/2023		25 816		7 485	24	(6)	18	0,00
BRC	01/2023	€	318		340	1	0	1	0,00
	01/2023	$	1 805	€	1 698	8	0	8	0,00
	09/2023	ZAR	253 669	$	14 363	0	(245)	(245)	(0,01)
CBK	01/2023	€	1 867		1 962	0	(32)	(32)	0,00
	01/2023	$	99	BRL	522	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		2 490	€	2 347	16	0	16	0,00
	01/2023	ZAR	60 553	$	3 456	0	(96)	(96)	0,00
	02/2023	ILS	115 874		33 708	820	0	820	0,03
	02/2023	PEN	23 290		5 807	0	(276)	(276)	(0,01)
	02/2023	$	2 358	PEN	9 406	101	0	101	0,00
	03/2023	COP	5 821 009	$	1 208	24	0	24	0,00
	03/2023	ILS	31 516		9 238	261	0	261	0,01
	03/2023	MXN	227 984		11 621	83	0	83	0,00
	03/2023	$	215	MXN	4 444	10	0	10	0,00
	05/2023	ILS	47 207	$	14 745	1 269	0	1 269	0,05
	05/2023	PEN	4 396		1 112	0	(29)	(29)	0,00
	07/2023	ILS	183 353		56 947	4 376	0	4 376	0,18
	08/2023		133 218		41 282	3 025	0	3 025	0,12
	11/2023		55 124		16 527	582	0	582	0,02
	11/2023	$	1 610	EGP	51 961	143	0	143	0,01
DUB	07/2023	ILS	24 133	$	6 892	0	(37)	(37)	0,00
	11/2023	EGP	146 354		5 151	216	0	216	0,01
GLM	01/2023	BRL	522		100	2	0	2	0,00
	01/2023	CNH	354		51	0	0	0	0,00
	01/2023	HUF	841		2	0	0	0	0,00
	01/2023	$	134	HUF	51 836	3	0	3	0,00
	01/2023		54	MYR	239	0	0	0	0,00
	01/2023		105	PLN	530	16	0	16	0,00
	02/2023		100	BRL	522	0	(2)	(2)	0,00
	04/2023	DOP	94 104	$	1 711	68	0	68	0,00
	05/2023	$	11 140	PEN	44 326	361	0	361	0,01
	05/2023		45	ZAR	753	0	(1)	(1)	0,00
	11/2023	EGP	25 380	$	900	44	0	44	0,00
	11/2023	$	5 231	EGP	158 950	129	0	129	0,01
JPM	01/2023	£	11 424	$	13 795	51	0	51	0,00
	01/2023	HUF	3 331 008		8 496	0	(381)	(381)	(0,01)
	01/2023	$	13	CNY	87	0	0	0	0,00
	01/2023		6 533	TRY	124 379	33	0	33	0,00
	03/2023		23	CNY	156	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	€	188 331	$	197 379	0	(3 704)	(3 704)	(0,15)
	01/2023	¥	148 200		1 094	0	(30)	(30)	0,00
	01/2023	$	1 594	€	1 496	3	0	3	0,00
	02/2023	MXN	77	$	4	0	0	0	0,00
	05/2023	$	51	CNH	343	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01/2023	€	4 422	$	4 717	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	£	7		9	0	0	0	0,00
	01/2023	$	35	€	32	0	0	0	0,00
	01/2023		2 148	£	1 781	0	(4)	(4)	0,00
	02/2023	ZAR	2 377	$	130	0	(9)	(9)	0,00
	05/2023		753		42	0	(2)	(2)	0,00
	11/2023	EGP	40 209		1 425	69	0	69	0,00
RBC	03/2023	$	19	MXN	384	0	0	0	0,00
	04/2023	MXN	90 650	$	4 373	0	(189)	(189)	(0,01)
SCX	01/2023	$	54	£	44	0	0	0	0,00
	01/2023	ZMW	21 720	$	1 204	3	0	3	0,00
	03/2023	AED	25 350		6 902	0	0	0	0,00
	04/2023	ZAR	198 324		10 781	0	(778)	(778)	(0,03)
SOG	01/2023		8 492		479	0	(20)	(20)	0,00
UAG	01/2023	£	3 097		3 808	82	0	82	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	01/2023	TRY 123 492	$ 6 167	$ 0	$ (352)	$ (352)	(0,01)
	03/2023	ZAR 33 735	1 887	0	(82)	(82)	0,00
	09/2023	83 188	4 745	0	(46)	(46)	0,00
	11/2023	ILS 7 970	2 305	0	(1)	(1)	0,00
				$ 12 264	$ (7 041)	$ 5 223	0,21

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA			CH				
	01/2023	$ 18 830	F 17 802	$ 424	$ 0	$ 424	0,02
BRC	01/2023	3 710	3 439	9	0	9	0,00
CBK	01/2023	33 144	31 311	721	0	721	0,03
MYI	01/2023	383	362	8	0	8	0,00
SCX	01/2023	455	422	1	0	1	0,00
				$ 1 163	$ 0	$ 1 163	0,05

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€ 1 065	$ 1 123	$ 0	$ (14)	$ (14)	0,00
BPS	01/2023	780	832	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 611	€ 572	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	€ 3 997	$ 4 246	0	(21)	(21)	0,00
	01/2023	$ 413 441	€ 397 738	11 227	0	11 227	0,46
JPM	01/2023	€ 7 952	$ 8 269	0	(223)	(223)	(0,01)
MBC	01/2023	17 247	18 364	0	(51)	(51)	(0,01)
	01/2023	$ 465 019	€ 443 666	8 686	0	8 686	0,35
SCX	01/2023	405 516	389 601	10 463	0	10 463	0,42
				$ 30 376	$ (310)	$ 30 066	1,21

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 24	$ 30	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	01/2023	$ 68 167	£ 56 611	0	(59)	(59)	0,00
BPS	01/2023	£ 125	$ 151	1	0	1	0,00
	01/2023	$ 115	£ 95	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	£ 1 525	$ 1 837	2	0	2	0,00
	01/2023	$ 24	£ 20	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	£ 134	$ 163	2	0	2	0,00
	01/2023	$ 73 238	£ 61 010	281	(119)	162	0,01
MYI	01/2023	1 985	1 615	0	(42)	(42)	0,00
UAG	01/2023	£ 113	$ 139	4	0	4	0,00
	01/2023	$ 54 244	£ 45 149	76	(2)	74	0,00
				$ 367	$ (222)	$ 145	0,01

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Investisseurs en NOK (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BRC	01/2023	$ 156	NOK 1 551	$ 2	$ 0	$ 2	0,00
CBK	01/2023	173	1 715	1	0	1	0,00
MBC	01/2023	30	290	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	168	1 662	1	0	1	0,00
				$ 4	$ 0	$ 4	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Investisseurs en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	SEK 275	$ 27	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$ 63	SEK 643	0	(1)	(1)	0,00
BRC	01/2023	728	7 620	4	0	4	0,00
CBK	01/2023	SEK 270	$ 26	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 219	SEK 2 279	0	0	0	0,00

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

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
MBC	01/2023	SEK	65	$	6	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$	167	SEK	1 747	1	0	1	0,00
MYI	01/2023	SEK	51	$	5	0	0	0	0,00
	01/2023	$	123	SEK	1 289	1	0	1	0,00
SCX	01/2023		16		162	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	SEK	196	$	19	0	0	0	0,00
	01/2023	$	1 423	SEK	14 926	10	0	10	0,00
						$ 16	$ (1)	$ 15	0,00
Total des Instruments financiers dérivés hors cote								**$ 32 314**	**1,30**

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CERTIFICATS DE DÉPÔT				
Bancolombia S.A.				
2,860 % éch. 25/02/2024	COP	6 070 000	$ 1 168	0,05
12,021 % éch. 04/08/2023		2 428 000	491	0,02
Total des Certificats de dépôt			**$ 1 659**	**0,07**
Total des Investissements			**$ 2 501 462**	**100,35**
Autres actifs et passifs à court terme			**$ (8 987)**	**(0,35)**
Actif net			**$ 2 492 475**	**100,00**

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

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

(d) Titre convertible conditionnel.

(e) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,99 %) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Banque de développement d'Afrique du Sud	8,600 %	21/10/2024	07/10/2021	$ 17 010	$ 14 659	0,59
JPMorgan Structured Products BV	12,000	04/01/2027	15/06/2021	737	1 003	0,04
JPMorgan Structured Products BV	14,000	09/12/2031	01/06/2021	210	246	0,01
				$ 17 957	$ 15 908	0,64

(f) Des titres d'une juste valeur globale de 38 910 $ (31 décembre 2021 : 177 076 $) et un montant en numéraire de 300 $ (31 décembre 2021 : 1 550 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 807 $ (31 décembre 2021 : 1 001 $) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 18 655 $ (31 décembre 2021 : 7 968 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 2 623 $) et un montant en numéraire de 6 470 $ (31 décembre 2021 : 2 820 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 2 396 551	$ 25 705	$ 2 422 256
Contrats de mise en pension	0	44 661	0	44 661
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	1 659	1 659
Instruments financiers dérivés[3]	5 273	27 624	(11)	32 886
Totaux	**$ 5 273**	**$ 2 468 836**	**$ 27 353**	**$ 2 501 462**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 2 686 487	$ 17 783	$ 2 704 270
Contrats de mise en pension	0	51 143	0	51 143
Instruments financiers dérivés[3]	2 326	8 628	(46)	10 908
Totaux	**$ 2 326**	**$ 2 746 258**	**$ 17 737**	**$ 2 766 321**

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

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

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

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	En % de l'actif net
BPS	2,000 %	21/12/2022	TBD[1]	€ (18 269)	$ (19 510)	(0,78)
	2,050	21/12/2022	TBD[1]	(1 417)	(1 513)	(0,06)
BRC	1,000	27/09/2022	TBD[1]	$ (1 513)	(1 512)	(0,06)
	3,500	25/11/2022	TBD[1]	(2 162)	(2 169)	(0,09)
	3,750	04/08/2022	TBD[1]	(1 715)	(1 726)	(0,07)
	3,800	03/08/2022	TBD[1]	(755)	(761)	(0,03)
MEI	3,250	13/10/2022	11/10/2024	(4 434)	(4 460)	(0,18)
NOM	2,500	16/12/2022	TBD[1]	(2 117)	(2 119)	(0,09)
	4,300	16/12/2022	TBD[1]	(5 061)	(5 070)	(0,20)
Total des Contrats de prise en pension					**$ (38 840)**	**(1,56)**

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ 5	$ 0	$ 5	$ (455)	$ 583	$ 128
BPS	(1 369)	2 060	691	(777)	1 040	263
BRC	(218)	320	102	(253)	295	42
CBK	22 572	(21 703)	869	(551)	361	(190)
DUB	(250)	270	20	(482)	570	88
FBF	(5)	0	(5)	S/O	S/O	S/O
GLM	619	(580)	39	913	(620)	293
GST	(2 119)	2 110	(9)	(1 354)	1 384	30
HUS	1	0	1	8	0	8
IND	S/O	S/O	S/O	215	(80)	135
JPM	(645)	680	35	(859)	1 030	171
MBC	5 068	(4 320)	748	S/O	S/O	S/O
MYC	(538)	760	222	53	180	233
MYI	23	0	23	120	0	120
RBC	(189)	0	(189)	4 489	(3 590)	899
RYL	S/O	S/O	S/O	50	0	50
SCX	9 690	(9 190)	500	3 219	(2 070)	1 149
SOG	(20)	0	(20)	S/O	S/O	S/O
SSB	S/O	S/O	S/O	202	(90)	112
TOR	S/O	S/O	S/O	4 714	(3 020)	1 694
UAG	(311)	270	(41)	523	(160)	363

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	84,95	82,78
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	12,05	19,80
Autres valeurs mobilières	0,17	0,02
Contrats de mise en pension	1,79	1,94
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,04	0,09
Instruments financiers dérivés compensés	(0,02)	(0,05)
Instruments financiers dérivés hors cote	1,30	0,37
Certificats de dépôt	0,07	S/O
Contrats de prise en pension	(1,56)	(6,34)

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

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Argentine	1,90	2,15
Arménie	0,27	0,30
Autriche	S/O	0,01
Azerbaïdjan	S/O	0,10
Bahamas	0,33	0,12
Bahreïn	0,93	1,04
Bénin	0,36	0,48
Bermudes	0,13	0,16
Brésil	3,00	4,18
Îles Caïmans	2,06	3,26
Chili	2,80	2,38
Chine	0,01	0,23
Colombie	2,57	2,32
Costa Rica	1,12	1,04
Chypre	0,24	S/O
République dominicaine	2,95	3,00
Équateur	2,19	2,10
Égypte	2,28	4,38
Salvador	0,48	0,58
France	0,10	S/O
Géorgie	0,39	0,42
Allemagne	0,02	0,02
Ghana	1,16	2,24
Guernesey, Îles Anglo-Normandes	0,12	0,16
Hong Kong	1,28	1,32
Hongrie	2,09	1,04
Inde	1,69	2,03
Indonésie	2,63	2,47
Irlande	0,08	0,43
Île de Man	S/O	0,14
Israël	2,24	0,22
Côte d'Ivoire	1,27	1,61
Jamaïque	0,17	0,20
Jersey, Îles Anglo-Normandes	0,48	S/O
Jordanie	0,38	0,77
Kazakhstan	1,46	0,94
Kenya	0,54	0,79
Luxembourg	0,36	0,38
Malaisie	0,13	0,02
Île Maurice	0,85	1,44
Mexique	2,31	2,88
Mongolie	0,65	0,55
Maroc	0,77	1,37
Multinationales	0,02	0,02
Namibie	0,09	0,09
Pays-Bas	0,87	1,48
Oman	3,07	3,48
Panama	2,85	2,43
Paraguay	0,91	0,85
Pérou	1,36	1,48
Philippines	1,24	1,64
Pologne	0,40	S/O
Qatar	1,81	1,54
Roumanie	2,26	2,23
Russie	0,04	0,71
Rwanda	S/O	0,09
Sénégal	0,41	0,71
Serbie	0,84	0,75
Singapour	0,43	0,87
Afrique du Sud	3,59	2,91
Corée du Sud	4,60	4,86
Espagne	0,38	S/O
Sri Lanka	0,67	1,26
Supranationales	1,81	1,71
Suisse	0,58	S/O
Tanzanie	0,24	0,35
Tunisie	0,34	0,11
Turquie	2,08	2,96
Ukraine	0,78	3,53
Émirats arabes unis	1,00	1,05
Royaume-Uni	1,65	0,46
États-Unis	7,06	2,29
Uruguay	1,65	2,33
Ouzbékistan	0,03	S/O
Vietnam	0,04	0,04
Îles Vierges britanniques	0,73	0,28
Zambie	0,12	0,20
Instruments à court terme	8,43	10,62
Contrats de mise en pension	1,79	1,94
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,04	0,09

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	0,00	S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	S/O
Swaps de taux d'intérêt	(0,02)	(0,05)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	0,00	(0,04)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,18)	(0,13)
Swaps de volatilité	0,00	S/O
Contrats de change à terme	0,21	(0,06)
Contrats de change à terme couverts	1,27	0,60
Certificats de dépôt	0,07	S/O
Autres actifs et passifs à court terme	(0,35)	(4,95)
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
République de Côte d'Ivoire				
6,608 % éch. 19/03/2027	€	900	$ 918	0,55
SOCAR Turkey Enerji A/S				
4,214 % éch. 11/08/2026		1 000	1 019	0,60
			1 937	1,15
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				
AIA Group Ltd.				
3,600 % éch. 09/04/2029	$	1 100	1 002	0,59
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				
5,950 % éch. 15/04/2030 ^(g)		1 300	82	0,05
Banco BTG Pactual S.A.				
4,500 % éch. 10/01/2025		200	193	0,11
Banco de Chile				
2,990 % éch. 09/12/2031		1 200	1 022	0,60
Banco de Credito del Peru S.A.				
2,700 % éch. 11/01/2025		1 300	1 233	0,73
Banco de Credito e Inversiones S.A.				
3,500 % éch. 12/10/2027		1 000	922	0,55
Banco Inbursa S.A.				
4,375 % éch. 11/04/2027		1 325	1 251	0,74
Banco Internacional del Peru SAA Interbank				
3,250 % éch. 04/10/2026		1 000	911	0,54
Banco Mercantil del Norte S.A.				
6,625 % éch. 24/01/2032 (e)(g)		250	207	0,12
Banco Santander Chile				
2,700 % éch. 10/01/2025		1 200	1 140	0,67
Banco Santander Mexico S.A.				
5,375 % éch. 17/04/2025		1 800	1 785	1,06
Bangkok Bank PCL				
3,733 % éch. 25/09/2034 (g)		1 200	1 005	0,59
Bank Hapoalim B.M.				
3,255 % éch. 21/01/2032 (g)		1 100	951	0,56
Bank Leumi Le-Israel B.M.				
3,275 % éch. 29/01/2031 (g)		1 800	1 601	0,95
Bank Mandiri Persero Tbk PT				
2,000 % éch. 19/04/2026		800	715	0,42
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT				
3,750 % éch. 30/03/2026 (g)		800	744	0,44
BOC Aviation Ltd.				
1,750 % éch. 21/01/2026		700	630	0,37
Cibanco S.A. Ibm				
4,962 % éch. 18/07/2029		900	821	0,49
Country Garden Holdings Co. Ltd.				
3,125 % éch. 22/10/2025		900	552	0,33
Credit Suisse Group AG				
6,373 % éch. 15/07/2026		400	376	0,22
Banque de développement d'Afrique du Sud				
8,600 % éch. 21/10/2024 (h)	ZAR	22 300	1 290	0,76
Emaar Sukuk Ltd.				
3,875 % éch. 17/09/2029	$	400	371	0,22
Fab Sukuk Co. Ltd.				
2,500 % éch. 21/01/2025		325	309	0,18
3,875 % éch. 22/01/2024		1 500	1 481	0,88
First Abu Dhabi Bank PJSC				
5,125 % éch. 13/10/2027		900	919	0,54
GLP Pte Ltd.				
4,500 % éch. 17/05/2026 (e)		300	154	0,09
GLP Pte. Ltd.				
3,875 % éch. 04/06/2025		200	163	0,10
Growthpoint Properties International Pty. Ltd.				
5,872 % éch. 02/05/2023		1 050	1 046	0,62
Hipotecaria Su Casita S.A. de C.V.				
9,620 % éch. 28/06/2018 ^	MXN	34 709	57	0,03
Huarong Finance Co. Ltd.				
3,375 % éch. 24/02/2030	$	500	382	0,23
5,500 % éch. 16/01/2025		200	190	0,11
IIRSA Norte Finance Ltd.				
8,750 % éch. 30/05/2024		16	17	0,01
Indian Railway Finance Corp. Ltd.				
3,570 % éch. 21/01/2032		800	688	0,41
Interoceanica Finance Ltd.				
0,000 % éch. 30/11/2025 (c)	$	37	$ 30	0,02
Kaisa Group Holdings Ltd.				
9,375 % éch. 30/06/2024 ^		300	42	0,02
9,750 % éch. 28/09/2023 ^		1 400	197	0,12
Kookmin Bank				
2,500 % éch. 04/11/2030 (g)		1 100	878	0,52
Kuwait Projects Co. SPC Ltd.				
4,500 % éch. 23/02/2027		482	407	0,24
Lloyds Banking Group PLC				
4,716 % éch. 11/08/2026		300	294	0,17
MAF Sukuk Ltd.				
4,638 % éch. 14/05/2029		1 000	976	0,58
MDGH GMTN RSC Ltd.				
5,500 % éch. 28/04/2033		300	318	0,19
Mizrahi Tefahot Bank Ltd.				
3,077 % éch. 07/04/2031 (g)		1 300	1 146	0,68
Muthoot Finance Ltd.				
4,400 % éch. 02/09/2023		700	690	0,41
NBK SPC Ltd.				
1,625 % éch. 15/09/2027		1 200	1 057	0,62
NE Property BV				
1,875 % éch. 09/10/2026	€	500	450	0,27
2,000 % éch. 20/01/2030		100	74	0,04
New Metro Global Ltd.				
6,800 % éch. 05/08/2023	$	1 100	1 017	0,60
NWD Finance BVI Ltd.				
4,125 % éch. 10/03/2028 (e)		200	147	0,09
6,250 % éch. 07/03/2024 (e)		200	150	0,09
OEC Finance Ltd. (4,375 % en numéraire ou 4,375 % de rémunération en nature)				
4,375 % éch. 25/10/2029 (a)		719	22	0,01
OEC Finance Ltd. (5,250 % en numéraire ou 5,250 % de rémunération en nature)				
5,250 % éch. 27/12/2033 (a)		440	10	0,01
OEC Finance Ltd. (7,125 % en numéraire ou 7,125 % de rémunération en nature)				
7,125 % éch. 26/12/2046 (a)		1 578	44	0,03
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.				
5,950 % éch. 30/04/2025		1 300	385	0,23
QNB Finance Ltd.				
2,625 % éch. 12/05/2025		500	473	0,28
3,500 % éch. 28/03/2024		1 548	1 517	0,90
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
5,250 % éch. 23/05/2023 ^(g)		1 700	229	0,14
Shinhan Bank Co. Ltd.				
4,500 % éch. 26/03/2028		900	834	0,49
Shinhan Card Co. Ltd.				
2,500 % éch. 27/01/2027		500	438	0,26
Shriram Finance Ltd.				
4,150 % éch. 18/07/2025		327	302	0,18
SNB Funding Ltd.				
2,900 % éch. 29/01/2027		1 700	1 578	0,93
Sovcombank Via SovCom Capital DAC				
3,400 % éch. 26/01/2025 ^		1 100	89	0,05
Standard Chartered PLC				
7,767 % éch. 16/11/2028		200	212	0,13
Sunac China Holdings Ltd.				
6,500 % éch. 09/07/2023 ^		500	111	0,07
7,000 % éch. 09/07/2025 ^		600	131	0,08
Trust Fibra Uno				
6,390 % éch. 15/01/2050		400	324	0,19
Turkiye Is Bankasi A/S				
6,125 % éch. 25/04/2024		200	199	0,12
Woori Bank				
4,750 % éch. 30/04/2024 (g)		1 000	984	0,58
Yango Justice International Ltd.				
7,500 % éch. 17/02/2025 ^		400	15	0,01
7,875 % éch. 04/09/2024 ^		200	7	0,00
Yanlord Land HK Co. Ltd.				
5,125 % éch. 20/05/2026		600	502	0,30
			40 489	23,96
INDUSTRIE				
AAC Technologies Holdings, Inc.				
3,750 % éch. 02/06/2031		200	149	0,09
ABJA Investment Co. Pte. Ltd.				
5,450 % éch. 24/01/2028		1 000	977	0,58
Adani Electricity Mumbai Ltd.				
3,949 % éch. 12/02/2030	$	400	$ 306	0,18
Alfa Desarrollo SpA				
4,550 % éch. 27/09/2051		797	607	0,36
ALROSA Finance S.A.				
3,100 % éch. 25/06/2027 ^		1 100	166	0,10
America Movil S.A.B. de C.V.				
5,375 % éch. 04/04/2032		400	362	0,21
Andrade Gutierrez International S.A.				
11,000 % éch. 20/08/2021 ^		0	0	0,00
AngloGold Ashanti Holdings PLC				
3,375 % éch. 01/11/2028		200	175	0,10
3,750 % éch. 01/10/2030		300	260	0,15
6,500 % éch. 15/04/2040		800	768	0,45
Antofagasta PLC				
2,375 % éch. 14/10/2030		700	563	0,33
5,625 % éch. 13/05/2032		200	196	0,12
ATP Tower Holdings LLC				
4,050 % éch. 27/04/2026		500	442	0,26
Axiata SPV2 Bhd.				
2,163 % éch. 19/08/2030		300	243	0,14
Axiata SPV5 Labuan Ltd.				
3,064 % éch. 19/08/2050		500	333	0,20
BOC Aviation USA Corp.				
1,625 % éch. 29/04/2024		700	665	0,39
Braskem Netherlands Finance BV				
4,500 % éch. 10/01/2028		700	629	0,37
Canacol Energy Ltd.				
5,750 % éch. 24/11/2028		700	619	0,37
Celulosa Arauco y Constitucion S.A.				
5,500 % éch. 30/04/2049		500	446	0,26
Champion Path Holdings Ltd.				
4,850 % éch. 27/01/2028		200	169	0,10
China Modern Dairy Holdings Ltd.				
2,125 % éch. 14/07/2026		600	510	0,30
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature)				
3,000 % éch. 31/12/2026 (a)		302	178	0,11
Corp. GEO S.A.B. de C.V.				
8,875 % éch. 25/09/2014 ^		850	0	0,00
CSN Inova Ventures				
6,750 % éch. 28/01/2028		700	670	0,40
CT Trust				
5,125 % éch. 03/02/2032		1 000	880	0,52
Digicel International Finance Ltd.				
8,750 % éch. 25/05/2024		145	125	0,07
DTEK Energy BV (3,500 % en numéraire et 3,500 % de rémunération en nature)				
7,000 % éch. 31/12/2027 (a)		738	204	0,12
Ecopetrol S.A.				
6,875 % éch. 29/04/2030		2 100	1 908	1,14
7,375 % éch. 18/09/2043		1 000	853	0,51
Energean Israel Finance Ltd.				
4,500 % éch. 30/03/2024		400	387	0,23
4,875 % éch. 30/03/2026		300	278	0,16
5,375 % éch. 30/03/2028		800	720	0,43
Fomento Economico Mexicano S.A.B. de C.V.				
1,000 % éch. 28/05/2033	€	250	186	0,11
4,375 % éch. 10/05/2043	$	400	331	0,20
Fortune Star BVI Ltd.				
3,950 % éch. 02/10/2026	€	500	307	0,18
5,950 % éch. 19/10/2025	$	300	232	0,14
Freeport Indonesia PT				
4,763 % éch. 14/04/2027		900	869	0,51
6,200 % éch. 14/04/2052		800	700	0,41
Fresnillo PLC				
4,250 % éch. 02/10/2050		800	631	0,37
GEMS MENASA Cayman Ltd.				
7,125 % éch. 31/07/2026		200	193	0,11
Geopark Ltd.				
5,500 % éch. 17/01/2027		800	689	0,41
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.				
6,125 % éch. 15/05/2029		700	709	0,42
Grupo Bimbo S.A.B. de C.V.				
4,000 % éch. 06/09/2049		800	609	0,36
Guara Norte SARL				
5,198 % éch. 15/06/2034		1 093	926	0,55

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Health & Happiness H&H International Holdings Ltd.				
5,625 % éch. 24/10/2024	$	800	$ 711	0,42
Hikma Finance USA LLC				
3,250 % éch. 09/07/2025		1 000	930	0,55
HTA Group Ltd.				
7,000 % éch. 18/12/2025		600	558	0,33
ICL Group Ltd.				
6,375 % éch. 31/05/2038		400	394	0,23
IHS Netherlands Holdco BV				
8,000 % éch. 18/09/2027		1 060	939	0,56
Industrias Penoles S.A.B. de C.V.				
4,750 % éch. 06/08/2050		800	663	0,39
InRetail Consumer				
3,250 % éch. 22/03/2028		1 200	1 034	0,61
Invepar Holdings LLC				
1,000 % éch. 31/12/2049 (h)		210	0	0,00
Inversiones CMPC S.A.				
3,000 % éch. 06/04/2031		500	419	0,25
JSW Steel Ltd.				
5,050 % éch. 05/04/2032		600	474	0,28
Kosmos Energy Ltd.				
7,125 % éch. 04/04/2026		1 010	863	0,51
Lenovo Group Ltd.				
3,421 % éch. 02/11/2030		200	159	0,09
Leviathan Bond Ltd.				
6,125 % éch. 30/06/2025		600	588	0,35
6,500 % éch. 30/06/2027		800	779	0,46
LG Chem Ltd.				
3,625 % éch. 15/04/2029		1 600	1 464	0,87
Medco Oak Tree Pte. Ltd.				
7,375 % éch. 14/05/2026		700	668	0,40
Melco Resorts Finance Ltd.				
4,875 % éch. 06/06/2025		600	552	0,33
5,375 % éch. 04/12/2029		400	322	0,19
5,750 % éch. 21/07/2028		400	335	0,20
Metalsa S.A. de C.V.				
3,750 % éch. 04/05/2031		600	473	0,28
Metinvest BV				
5,625 % éch. 17/06/2025	€	850	503	0,30
8,500 % éch. 23/04/2026	$	200	107	0,06
MGM China Holdings Ltd.				
5,375 % éch. 15/05/2024		800	773	0,46
MTN Mauritius Investments Ltd.				
4,755 % éch. 11/11/2024		365	356	0,21
Nakilat, Inc.				
6,067 % éch. 31/12/2033		368	380	0,23
Novolipetsk Steel Via Steel Funding DAC				
1,450 % éch. 02/06/2026	€	500	360	0,21
OAS Restructuring BVI Ltd.				
5,000 % éch. 31/03/2035 (h)	BRL	475	4	0,00
OCP S.A.				
5,125 % éch. 23/06/2051	$	1 400	1 068	0,63
6,875 % éch. 25/04/2044		300	285	0,17
Odebrecht Holdco Finance Ltd.				
0,000 % éch. 10/09/2058 (c)		3 424	4	0,00
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				
0,000 % éch. 30/01/2023 (c)(e)		1 416	3	0,00
Periama Holdings LLC				
5,950 % éch. 19/04/2026		300	281	0,17
Pertamina Persero PT				
5,625 % éch. 20/05/2043		800	737	0,44
Petroleos Mexicanos				
6,500 % éch. 02/06/2041		500	327	0,19
6,750 % éch. 21/09/2047		500	320	0,19
Petron Corp.				
5,950 % éch. 19/04/2026 (e)		300	258	0,15
Petronas Capital Ltd.				
3,404 % éch. 28/04/2061		500	347	0,21
Petrorio Luxembourg Trading SARL				
6,125 % éch. 09/06/2026		500	476	0,28
Prosus NV				
3,061 % éch. 13/07/2031		1 500	1 160	0,69
3,257 % éch. 19/01/2027		200	179	0,11
4,027 % éch. 03/08/2050		300	188	0,11
4,987 % éch. 19/01/2052		600	426	0,25
Ras Laffan Liquefied Natural Gas Co. Ltd.				
6,332 % éch. 30/09/2027	$	658	$ 666	0,39
Rede D'or Finance SARL				
4,500 % éch. 22/01/2030		213	184	0,11
Reliance Industries Ltd.				
2,875 % éch. 12/01/2032		900	731	0,43
ReNew Power Pvt Ltd.				
5,875 % éch. 05/03/2027		500	481	0,28
Rolls-Royce PLC				
5,750 % éch. 15/10/2027	£	300	332	0,20
Sands China Ltd.				
3,350 % éch. 08/03/2029	$	300	246	0,15
4,300 % éch. 08/01/2026		200	185	0,11
4,875 % éch. 18/06/2030		450	396	0,23
5,625 % éch. 08/08/2025		300	287	0,17
5,900 % éch. 08/08/2028		900	844	0,50
Sappi Papier Holding GmbH				
7,500 % éch. 15/06/2032		305	277	0,16
Sasol Financing USA LLC				
5,875 % éch. 27/03/2024		500	490	0,29
6,500 % éch. 27/09/2028		1 700	1 547	0,92
Saudi Arabian Oil Co.				
2,250 % éch. 24/11/2030		2 100	1 735	1,03
4,250 % éch. 16/04/2039		1 500	1 346	0,80
Seplat Energy PLC				
7,750 % éch. 01/04/2026		400	322	0,19
Severstal OAO Via Steel Capital S.A.				
3,150 % éch. 16/09/2024 ^		800	121	0,07
SK Hynix, Inc.				
2,375 % éch. 19/01/2031		800	587	0,35
SMC Global Power Holdings Corp.				
5,450 % éch. 09/12/2026 (e)		200	134	0,08
Stillwater Mining Co.				
4,000 % éch. 16/11/2026		1 400	1 238	0,73
Studio City Finance Ltd.				
6,500 % éch. 15/01/2028		900	700	0,41
Suzano Austria GmbH				
3,750 % éch. 15/01/2031		300	252	0,15
7,000 % éch. 16/03/2047		400	400	0,24
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.				
3,250 % éch. 15/08/2030		700	502	0,30
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV				
3,750 % éch. 09/05/2027	€	1 600	1 484	0,88
Tullow Oil PLC				
10,250 % éch. 15/05/2026	$	377	303	0,18
Turkish Airlines Pass-Through Trust				
4,200 % éch. 15/09/2028		609	534	0,32
Unigel Luxembourg S.A.				
8,750 % éch. 01/10/2026		900	896	0,53
Vale Overseas Ltd.				
3,750 % éch. 08/07/2030		400	351	0,21
6,875 % éch. 21/11/2036		700	740	0,44
Vale S.A.				
0,000 % (e)	BRL	6 700	474	0,28
Wynn Macau Ltd.				
4,875 % éch. 01/10/2024	$	500	473	0,28
5,500 % éch. 15/01/2026		500	459	0,27
Xiaomi Best Time International Ltd.				
2,875 % éch. 14/07/2031		900	654	0,39
YPF S.A.				
6,950 % éch. 21/07/2027		500	355	0,21
Yunda Holding Investment Ltd.				
2,250 % éch. 19/08/2025		1 000	885	0,52
Zhongsheng Group Holdings Ltd.				
3,000 % éch. 13/01/2026		700	627	0,37
			64 275	38,05
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
Cikarang Listrindo Tbk PT				
4,950 % éch. 14/09/2026		500	468	0,28
Empresa Electrica Cochrane SpA				
5,500 % éch. 14/05/2027		199	184	0,11
Greenko Power Ltd.				
4,300 % éch. 13/12/2028		287	241	0,14
Greenko Solar Mauritius Ltd.				
5,550 % éch. 29/01/2025		1 000	944	0,56
5,950 % éch. 29/07/2026		300	275	0,16
IHS Holding Ltd.				
5,625 % éch. 29/11/2026	$	400	$ 334	0,20
India Green Energy Holdings				
5,375 % éch. 29/04/2024		1 250	1 203	0,71
Israel Electric Corp. Ltd.				
3,750 % éch. 22/02/2032		1 200	1 055	0,62
4,250 % éch. 14/08/2028		1 600	1 515	0,90
LLPL Capital Pte. Ltd.				
6,875 % éch. 04/02/2039		512	452	0,27
MSU Energy S.A.				
6,875 % éch. 01/02/2025		400	272	0,16
NGD Holdings BV				
6,750 % éch. 31/12/2026		284	132	0,08
Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % en numéraire et 1,000 % de rémunération en nature)				
7,350 % éch. 01/12/2026 ^(a)		0	0	0,00
Peru LNG SRL				
5,375 % éch. 22/03/2030		700	586	0,35
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				
5,250 % éch. 24/10/2042		300	256	0,15
Rio Oil Finance Trust				
8,200 % éch. 06/04/2028		1 958	1 987	1,17
9,250 % éch. 06/07/2024		77	78	0,04
9,750 % éch. 06/01/2027		554	576	0,34
S.A. Global Sukuk Ltd.				
2,694 % éch. 17/06/2031		1 000	857	0,51
Southern Gas Corridor CJSC				
6,875 % éch. 24/03/2026		900	925	0,55
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.				
6,750 % éch. 24/04/2033		811	768	0,45
Thaioil Treasury Center Co. Ltd.				
3,750 % éch. 18/06/2050		700	436	0,26
			13 544	8,01
Total des Obligations et billets privés			118 308	70,02
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				
5,000 % éch. 01/02/2053		1 300	1 281	0,76
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Obligations du Trésor américain				
3,000 % éch. 15/05/2045		8 000	6 598	3,90
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Canada Square Funding PLC				
3,735 % éch. 17/01/2059	£	95	110	0,06
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				
4,619 % éch. 25/10/2035	$	456	414	0,24
Citigroup Mortgage Loan Trust				
3,790 % éch. 25/08/2036		287	251	0,15
Countrywide Alternative Loan Trust				
4,993 % éch. 20/12/2035		50	43	0,03
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
3,726 % éch. 25/11/2037		32	29	0,02
Polaris PLC				
4,682 % éch. 27/05/2057	£	50	60	0,04
RMAC PLC				
4,206 % éch. 12/06/2046		104	125	0,07
Rochester Financing PLC				
4,126 % éch. 18/12/2044		144	167	0,10
Tower Bridge Funding PLC				
4,151 % éch. 20/12/2063		92	108	0,06
			1 307	0,77
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Citigroup Mortgage Loan Trust				
7,250 % éch. 25/05/2036	$	373	195	0,11
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,609 % éch. 25/09/2037 ^		39	40	0,02
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
4,579 % éch. 25/04/2037		142	94	0,06
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.				
5,364 % éch. 25/12/2035		1 100	984	0,58

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

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
NovaStar Mortgage Funding Trust					
4,589 % éch. 25/09/2037	$	118	$	114	0,07
				1 427	0,84
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement argentin					
0,500 % éch. 09/07/2030		18		4	0,00
1,500 % éch. 09/07/2035		11		3	0,00
Obligation internationale du gouvernement chilien					
4,340 % éch. 07/03/2042		900		764	0,45
Obligation internationale du gouvernement colombien					
4,500 % éch. 28/01/2026		1 000		943	0,56
Export-Credit Bank of Turkey					
8,250 % éch. 24/01/2024		900		914	0,54
Obligation internationale du gouvernement israélien					
0,150 % éch. 31/07/2023	ILS	2 700		750	0,44
1,500 % éch. 30/11/2023		6 000		1 669	0,99
Obligation internationale du gouvernement omanais					
6,250 % éch. 25/01/2031	$	400		404	0,24
Obligation internationale du gouvernement roumain					
4,625 % éch. 03/04/2049	€	500		387	0,23
Obligation internationale du gouvernement ukrainien					
4,375 % éch. 27/01/2032 ^		300		60	0,04
7,750 % éch. 01/09/2026 ^	$	300		65	0,04
				5 963	3,53

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ACTIONS ORDINAIRES			
ÉNERGIE			
Constellation Oil Services Holding S.A. « B » (b)(h)	361 648	$ 39	0,03
Frontera Energy Corp. (b)	50 258	458	0,27
		497	0,30
SERVICES FINANCIERS			
Hipotecaria Su Casita S.A. (b)	332 624	0	0,00
MATÉRIAUX			
Petra Diamonds Ltd. (b)	331 402	376	0,22
		873	0,52
BONS DE SOUSCRIPTION			
OAS S.A. - Exp. 21/01/2039 (h)	175 616	0	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BONS DU TRÉSOR HONGROIS				
18,250 % éch. 03/01/2023 (c)(d)	HUF	642 000	1 711	1,01
BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN				
1,734 % éch. 05/07/2023 (c)(d)	ILS	2 600	723	0,43

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS			
(0,163) % éch. 16/01/2023 (c)(d)	¥ 430 000	$ 3 259	1,93
Total des Instruments à court terme		5 693	3,37
Total des Valeurs mobilières		**$ 143 387**	**84,86**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	1 615 635	16 082	9,51
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (f)	25 272	337	0,20
		16 419	9,71
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)	1 000	99	0,06
Total des Fonds d'investissement		**$ 16 518**	**9,77**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BPS	4,310 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 6 100	Billets du Trésor américain 0,625 % échéance 15/05/2030	$ (6 235)	$ 6 100	$ 6 103	3,61
FICC	1,900	30/12/2022	03/01/2023	2 286	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 08/06/2023	(2 332)	2 286	2 286	1,35
Total des Contrats de mise en pension						**$ (8 567)**	**$ 8 386**	**$ 8 389**	**4,96**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	21	$ 192	0,11
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Long	03/2023	78	(1)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	59	(3)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	59	(15)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	25	(8)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	7	4	0,00
				$ 169	0,10
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ 169**	**0,10**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20/06/2026	€ 100	$ (19)	(0,01)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.EM-37 à 5 ans	1,000 %	20/06/2027	$ 490	$ 19	0,01
Indice CDX.EM-38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	3 800	95	0,06

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000 %	20/12/2027	$ 1 000	$ 40	0,03
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000	20/12/2027	5 400	21	0,01
Indice iTraxx Asia ex-Japan 38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	3 800	103	0,06
Indice iTraxx Crossover 38 à 5 ans	5,000	20/12/2027	€ 1 100	52	0,03
Indice iTraxx Europe Main 38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	1 200	6	0,00
				$ 336	0,20

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000 %	21/09/2024	$ 12 500	$ 304	0,18
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,750	21/06/2047	1 700	214	0,13
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,205	22/04/2027	ZAR 7 200	13	0,01
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,210	22/04/2027	35 600	(9)	(0,01)
					$ 522	0,31
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ 839**	**0,50**

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

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

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

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BRC	America Movil S.A.B. de C.V.	1,000 %	20/12/2025	$ 1 200	$ (30)	$ 37	$ 7	0,00
	QNB Finance Ltd.	1,000	20/06/2023	400	3	(2)	1	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2026	50	0	0	0	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2026	900	(42)	7	(35)	(0,02)
MYC	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2027	400	(14)	9	(5)	0,00
					$ (83)	$ 51	$ (32)	(0,02)

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

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

SWAPS DE VOLATILITÉ

Contrepartie	Volatilité à payer/à recevoir	Entité de référence	Taux d'exercice de volatilité	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	À payer	Volatilité réalisée au cours USD contre JPY à 1 an[1]	12,025 %	20/06/2023	$ 28	$ 0	$ 0	$ 0	0,00

(1) Swap de variance

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	¥	210 000	$	1 453	$ 0	$ (141)	$ (141)	(0,08)
BOA	03/2023	$	87	ZAR	1 529	3	0	3	0,00
BPS	01/2023	HUF	294 456	$	772	0	(13)	(13)	(0,01)
	01/2023	$	95	€	89	0	0	0	0,00
	01/2023		6	HUF	2 218	0	0	0	0,00
	02/2023	ZAR	7 388	$	412	0	(21)	(21)	(0,01)
	11/2023	ILS	3 988		1 152	0	(2)	(2)	0,00
BRC	01/2023	CNH	3 978		571	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	HUF	78 225		204	0	(5)	(5)	0,00
CBK	01/2023	BRL	1 464		279	2	0	2	0,00
	07/2023	ILS	5 208		1 570	75	0	75	0,05
GLM	01/2023	CNH	4 129		594	0	(4)	(4)	0,00

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

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	01/2023	$	275	BRL	1 464	$ 3	$ 0	$ 3	0,00
	01/2023		21	HKD	161	0	0	0	0,00
	04/2023	BRL	1 464	$	270	0	(3)	(3)	0,00
	05/2023	ZAR	2 683		161	5	0	5	0,00
JPM	01/2023	£	1 447		1 747	6	0	6	0,00
	01/2023	$	477	CNY	3 319	4	0	4	0,00
	01/2023		26	ILS	90	0	(1)	(1)	0,00
	03/2023		856	CNY	5 924	5	0	5	0,00
MBC	01/2023	€	5 506	$	5 770	0	(108)	(108)	(0,06)
	01/2023	¥	220 000		1 522	0	(147)	(147)	(0,09)
	01/2023	$	126	€	118	0	0	0	0,00
	01/2023		86	HKD	669	0	0	0	0,00
	05/2023	CNH	2 555	$	381	8	0	8	0,00
MYI	01/2023	€	47		51	0	0	0	0,00
	01/2023	$	5	€	5	0	0	0	0,00
SCX	04/2023	ZAR	8 444	$	459	0	(33)	(33)	(0,02)
UAG	01/2023	HUF	267 248		697	0	(16)	(16)	(0,01)
	01/2023	ZAR	7 403		413	0	(21)	(21)	(0,01)
	09/2023	$	96	ZAR	1 685	1	0	1	0,00
	11/2023	ILS	1 993	$	576	0	0	0	0,00
						$ 112	$ (520)	$ (408)	(0,24)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en CHF (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	3 956	CHF	3 741	$ 89	$ 0	$ 89	0,05
CBK	01/2023		6 740		6 367	147	0	147	0,09
MYI	01/2023	CHF	95	$	100	0	(3)	(3)	0,00
						$ 236	$ (3)	$ 233	0,14

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BPS	01/2023	€	28	$	30	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$	9	€	9	0	0	0	0,00
CBK	01/2023		34 771		33 532	1 032	0	1 032	0,61
MBC	01/2023	€	110	$	117	0	0	0	0,00
	01/2023	$	49 596	€	47 290	895	0	895	0,53
MYI	01/2023		6 378		6 048	79	0	79	0,04
SCX	01/2023		39 305		37 763	1 014	0	1 014	0,60
						$ 3 020	$ 0	$ 3 020	1,78

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$**	**2 813**	**1,66**
Total des Investissements	**$**	**172 112**	**101,85**
Autres actifs et passifs à court terme	**$**	**(3 126)**	**(1,85)**
Actif net	**$**	**168 986**	**100,00**

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

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

^ **Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.**

(a) **Titre à rémunération en nature.**

(b) **Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.**

(c) **Titre à coupon zéro.**

(d) **Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.**

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

(f) **Affilié au Fonds.**

(g) **Titre convertible conditionnel.**

(h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,66 %) :

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Constellation Oil Services Holding S.A. « B »	10/06/2022	$ 39	$ 39	0,03
Banque de développement d'Afrique du Sud 8,600 % échéance 21/10/2024	07/10/2021	1 498	1 290	0,76
Invepar Holdings LLC 1,000 % échéance 31/12/2049	16/11/2018	0	0	0,00
OAS Restructuring BVI Ltd. 5,000 % échéance 31/03/2035	16/11/2018	14	4	0,00
OAS S.A. - Exp. 21/01/2039	16/11/2018	5	0	0,00
		$ 1 556	$ 1 333	0,79

Un montant en numéraire de 1 839 $ (31 décembre 2021 : 1 115 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 458	$ 140 620	$ 2 309	$ 143 387
Fonds d'investissement	16 419	99	0	16 518
Contrats de mise en pension	0	8 386	0	8 386
Instruments financiers dérivés[3]	191	3 630	0	3 821
Totaux	**$ 17 068**	**$ 152 735**	**$ 2 309**	**$ 172 112**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 741	$ 192 610	$ 4 310	$ 197 661
Fonds d'investissement	10 650	0	0	10 650
Contrats de mise en pension	0	487	0	487
Instruments financiers dérivés[3]	0	1 245	0	1 245
Totaux	**$ 11 391**	**$ 194 342**	**$ 4 310**	**$ 210 043**

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

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

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ (141)	$ 0	$ (141)	$ S/O	$ S/O	$ S/O
BOA	92	(40)	52	9	0	9
BPS	(36)	0	(36)	73	0	73
BRC	(2)	0	(2)	31	0	31
CBK	1 221	(1 150)	71	(40)	0	(40)
DBL	S/O	S/O	S/O	3	0	3
DUB	S/O	S/O	S/O	1	0	1
GLM	1	0	1	112	0	112
GST	S/O	S/O	S/O	14	0	14
HUS	S/O	S/O	S/O	(28)	0	(28)
JPM	14	0	14	5	0	5
MBC	648	(550)	98	S/O	S/O	S/O
MYC	(5)	0	(5)	(19)	0	(19)
MYI	76	0	76	30	(60)	(30)
RBC	S/O	S/O	S/O	455	(300)	155
SCX	981	(940)	41	420	(340)	80
SSB	S/O	S/O	S/O	(2)	0	(2)
TOR	S/O	S/O	S/O	500	(390)	110
UAG	(36)	0	(36)	73	0	73

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	67,07	73,77
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	17,79	19,08
Fonds d'investissement	9,77	5,00
Contrats de mise en pension	4,96	0,23
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,10	0,00
Instruments financiers dérivés compensés	0,50	(0,19)
Instruments financiers dérivés hors cote	1,66	0,77

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Crédits consortiaux et cessions	1,15	1,06
Obligations et billets privés	70,02	81,26
Agences du gouvernement américain	0,76	S/O
Obligations du Trésor américain	3,90	4,84
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	0,77	0,51
Titres adossés à des actifs	0,84	0,80
Émissions souveraines	3,53	4,03
Actions ordinaires	0,52	0,35
Bons de souscription	0,00	0,00
Instruments à court terme	3,37	S/O
Fonds d'investissement	9,77	5,00
Contrats de mise en pension	4,96	0,23
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,10	0,00
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,01)	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,20	(0,01)
Swaps de taux d'intérêt	0,31	(0,18)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	S/O	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	S/O	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,02)	0,00
Swaps de taux d'intérêt	S/O	0,00
Swaps de volatilité	0,00	S/O
Contrats de change à terme	(0,24)	0,03
Contrats de change à terme couverts	1,92	0,74
Autres actifs et passifs à court terme	(1,85)	1,34
Actif net	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
ARGENTINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement argentin				
0,500 % éch. 09/07/2030	$	3 296	$ 857	0,42
1,500 % éch. 09/07/2035		673	153	0,07
Total Argentine			1 010	0,49
BAHAMAS				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement des Bahamas				
5,750 % éch. 16/01/2024		200	193	0,09
6,000 % éch. 21/11/2028		300	232	0,11
9,000 % éch. 16/06/2029		400	344	0,17
Total Bahamas			769	0,37
BIÉLORUSSIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de Biélorussie				
6,200 % éch. 28/02/2030 ^		200	68	0,03
6,378 % éch. 24/02/2031 ^		300	102	0,05
Total Biélorussie			170	0,08
BRÉSIL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco BTG Pactual S.A.				
8,300 % éch. 15/08/2024	BRL	10 000	1 791	0,87
Oi S.A.				
0,000 % éch. 25/02/2035		350	299	0,15
10,000 % éch. 27/07/2025	$	300	52	0,03
Vale S.A.				
0,000 % éch.	BRL	46 580	3 293	1,60
Total Brésil			5 435	2,65
ÎLES CAÏMANS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Kaisa Group Holdings Ltd.				
9,375 % éch. 30/06/2024 ^	$	3 400	478	0,23
9,750 % éch. 28/09/2023 ^		700	98	0,05
11,700 % éch. 11/11/2025 ^		200	28	0,02
Poinsettia Finance Ltd.				
6,625 % éch. 17/06/2031		824	699	0,34
Sunac China Holdings Ltd.				
6,500 % éch. 09/07/2023 ^		400	89	0,04
7,250 % éch. 14/06/2022 ^		200	42	0,02
Total Îles Caïmans			1 434	0,70
CHINE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Yango Justice International Ltd.				
7,500 % éch. 17/02/2025 ^		1 100	40	0,02
CONGO				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale congolaise				
6,000 % éch. 30/06/2029		665	557	0,27
DANEMARK				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	1 063	113	0,06
1,500 % éch. 01/10/2053		3 611	400	0,20
Nykredit Realkredit A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050		18 074	1 912	0,93
1,500 % éch. 01/10/2053		5 160	571	0,28
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050		6 091	645	0,31
1,000 % éch. 01/10/2053		2 646	269	0,13
1,500 % éch. 01/10/2053		3 217	356	0,17
Total Danemark			4 266	2,08

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
RÉPUBLIQUE DOMINICAINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Billets de la Banque centrale de la République dominicaine				
12,000 % éch. 03/10/2025	DOP	84 300	$ 1 443	0,70
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine				
8,900 % éch. 15/02/2023		95 100	1 686	0,82
Total République dominicaine			3 129	1,52
GHANA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement du Ghana				
8,625 % éch. 07/04/2034 ^	$	2 100	768	0,37
8,627 % éch. 16/06/2049 ^		200	71	0,04
8,750 % éch. 11/03/2061 ^		400	141	0,07
Total Ghana			980	0,48
IRLANDE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Black Diamond CLO DAC				
2,316 % éch. 20/01/2032	€	482	503	0,24
Cairn CLO DAC				
2,158 % éch. 15/10/2031		800	836	0,41
Carlyle Euro CLO DAC				
2,078 % éch. 15/01/2031		1 399	1 457	0,71
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
2,548 % éch. 15/11/2031		1 300	1 345	0,66
Harvest CLO DAC				
2,775 % éch. 26/06/2030		1 351	1 410	0,69
Oak Hill European Credit Partners DAC				
2,196 % éch. 20/10/2031		500	518	0,25
			6 069	2,96
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				
5,950 % éch. 15/04/2030 ^(e)	$	900	57	0,03
Sovcombank Via SovCom Capital DAC				
8,000 % éch. 07/04/2030 ^(e)		400	24	0,01
			81	0,04
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
European Loan Conduit DAC				
2,803 % éch. 17/02/2030	€	293	299	0,14
Total Irlande			6 449	3,14
ISRAËL				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement israélien				
0,150 % éch. 31/07/2023	ILS	20 800	5 779	2,82
CÔTE D'IVOIRE				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
République de Côte d'Ivoire				
6,608 % éch. 19/03/2027	€	900	917	0,45
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Corsair International Ltd.				
5,473 % éch. 28/01/2027		1 700	1 801	0,88
5,823 % éch. 28/01/2029		800	845	0,41
Total Jersey, Îles Anglo-Normandes			2 646	1,29
LUXEMBOURG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
FEL Energy SARL				
5,750 % éch. 01/12/2040	$	2 587	2 218	1,08
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
5,250 % éch. 23/05/2023 ^(e)		1 600	215	0,11
Total Luxembourg			2 433	1,19
MEXIQUE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Metalsa S.A. de C.V.				
3,750 % éch. 04/05/2031		800	631	0,31

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Petroleos Mexicanos				
6,375 % éch. 23/01/2045	$	1 800	$ 1 119	0,54
6,500 % éch. 02/06/2041		4 000	2 613	1,27
Trust Fibra Uno				
4,869 % éch. 15/01/2030		400	344	0,17
6,390 % éch. 15/01/2050		2 500	2 022	0,99
			6 729	3,28
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement mexicain				
7,750 % éch. 13/11/2042	MXN	16 000	717	0,35
8,000 % éch. 07/11/2047		14 000	641	0,31
8,500 % éch. 18/11/2038		16 000	778	0,38
			2 136	1,04
Total Mexique			8 865	4,32
PAYS-BAS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Mong Duong Finance Holdings BV				
5,125 % éch. 07/05/2029	$	2 800	2 334	1,14
Prosus NV				
3,832 % éch. 08/02/2051		1 300	790	0,38
Republic of Angola Via Avenir BV				
9,687 % éch. 07/12/2023		1 080	1 064	0,52
12,639 % éch. 01/07/2023		246	248	0,12
Total Pays-Bas			4 436	2,16
PÉROU				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % éch. 17/09/2024	PEN	2 600	637	0,31
Petroleos del Peru S.A.				
5,625 % éch. 19/06/2047	$	1 500	983	0,48
			1 620	0,79
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement péruvien				
5,940 % éch. 12/02/2029	PEN	700	168	0,08
6,350 % éch. 12/08/2028		2 600	649	0,32
6,950 % éch. 12/08/2031		200	50	0,02
8,200 % éch. 12/08/2026		14 700	4 037	1,97
			4 904	2,39
Total Pérou			6 524	3,18
POLOGNE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement polonais				
2,750 % éch. 25/04/2028	PLN	12 700	2 382	1,16
RUSSIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement russe				
1,125 % éch. 20/11/2027 ^	€	100	31	0,02
5,100 % éch. 28/03/2035 ^	$	200	66	0,03
Total Russie			97	0,05
SERBIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement serbe				
4,500 % éch. 20/08/2032	RSD	13 800	104	0,05
AFRIQUE DU SUD				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement sud-africain				
8,000 % éch. 31/01/2030	ZAR	75 100	3 936	1,92
10,500 % éch. 21/12/2026		102 900	6 394	3,12
Total Afrique du Sud			10 330	5,04
TUNISIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de la Banque centrale de Tunisie				
6,750 % éch. 31/10/2023	€	200	180	0,09

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
TURQUIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Turkish Airlines Pass-Through Trust				
4,200 % éch. 15/09/2028	$	499	$ 437	0,21
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
SOCAR Turkey Enerji A/S				
4,214 % éch. 11/08/2026	€	1 400	1 427	0,70
Total Turquie			1 864	0,91
ÉMIRATS ARABES UNIS				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Département des finances du gouvernement de Sharjah				
4,000 % éch. 28/07/2050	$	800	527	0,26
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Standard Chartered PLC				
7,776 % éch. 16/11/2025		300	309	0,15
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Canada Square Funding PLC				
3,735 % éch. 17/01/2059	£	286	331	0,16
Canterbury Finance PLC				
4,595 % éch. 16/05/2056		134	161	0,08
Finsbury Square PLC				
4,419 % éch. 16/12/2069		148	178	0,09
Polaris PLC				
4,682 % éch. 27/05/2057		50	60	0,03
RMAC PLC				
4,206 % éch. 12/06/2046		209	250	0,12
Rochester Financing PLC				
4,126 % éch. 18/12/2044		287	333	0,16
Stratton Mortgage Funding PLC				
4,287 % éch. 12/03/2052		68	82	0,04
Towd Point Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2045		739	879	0,43
Tower Bridge Funding PLC				
4,151 % éch. 20/12/2063		184	216	0,10
			2 490	1,21
Total Royaume-Uni			2 799	1,36
ÉTATS-UNIS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Aames Mortgage Investment Trust				
5,321 % éch. 25/06/2035	$	900	784	0,38
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
5,409 % éch. 25/04/2035		424	405	0,20
Citigroup Mortgage Loan Trust				
4,689 % éch. 25/10/2036	$	670	$ 438	0,21
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
5,364 % éch. 25/12/2035		338	334	0,16
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
4,599 % éch. 25/10/2036		196	192	0,10
4,659 % éch. 25/07/2036		266	221	0,11
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,364 % éch. 25/07/2034		23	22	0,01
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
4,709 % éch. 25/07/2036		900	846	0,41
			3 242	1,58
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
IndyMac Mortgage Loan Trust				
4,729 % éch. 25/11/2036		723	683	0,34
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Obligations du Trésor américain				
1,750 % éch. 15/08/2041		11 000	7 533	3,67
2,375 % éch. 15/02/2042		24 500	18 718	9,13
3,250 % éch. 15/05/2042		2 500	2 193	1,07
3,375 % éch. 15/08/2042		4 000	3 576	1,74
Billets du Trésor américain				
2,500 % éch. 30/04/2024		5 600	5 442	2,65
			37 462	18,26
Total États-Unis			41 387	20,18
OUZBÉKISTAN				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Ipoteka-Bank ATIB				
5,500 % éch. 19/11/2025		700	610	0,30
Uzbek Industrial and Construction Bank ATB				
5,750 % éch. 02/12/2024		700	659	0,32
Total Ouzbékistan			1 269	0,62
ÎLES VIERGES BRITANNIQUES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
1MDB Global Investments Ltd.				
4,400 % éch. 09/03/2023		2 600	2 546	1,24
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BILLETS À COURT TERME				
Federal Home Loan Bank				
4,320 % éch. 06/01/2023		1 400	1 400	0,68
4,320 % éch. 10/01/2023		1 400	1 400	0,68
			2 800	1,36
BONS DU TRÉSOR HONGROIS				
18,250 % éch.				
03/01/2023 (a)(b)	HUF	4 253 000	$ 11 334	5,53
BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN				
0,455 % éch.				
08/02/2023 (a)(b)	ILS	11 000	3 106	1,51
0,860 % éch.				
03/05/2023 (a)(b)		8 600	2 409	1,18
			5 515	2,69
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS				
(0,255) % éch.				
11/01/2023 (a)(b)	¥	493 900	3 743	1,82
(0,251) % éch.				
11/01/2023 (a)(b)		228 400	1 731	0,84
(0,245) % éch.				
10/01/2023 (a)(b)		1 642 000	12 445	6,08
(0,235) % éch.				
11/01/2023 (a)(b)		779 700	5 910	2,88
(0,209) % éch.				
06/01/2023 (a)(b)		736 000	5 578	2,72
(0,191) % éch.				
06/01/2023 (a)(b)		274 000	2 077	1,01
(0,125) % éch.				
13/02/2023 (a)(b)		274 900	2 084	1,02
(0,118) % éch.				
13/02/2023 (a)(b)		1 195 100	9 059	4,42
			42 627	20,79
Total des Instruments à court terme			62 276	30,37
Total des Valeurs mobilières			**$ 181 600**	**88,54**

		ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT				
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)		1 423 791	14 173	6,91
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE				
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d)		6 300	624	0,30
Total des Fonds d'investissement			**$ 14 797**	**7,21**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
SSB	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 706	Billets du Trésor américain 1,875 % échéance 30/06/2026	$ (720)	$ 706	$ 706	0,34
Total des Contrats de mise en pension						**$ (720)**	**$ 706**	**$ 706**	**0,34**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2023	135	$ 622	0,30
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	9	7	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Court	03/2023	8	165	0,08

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	9	$ (46)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Long	03/2023	115	(1)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	341	(46)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	13	(4)	0,00
				$ 697	0,34
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ 697**	**0,34**

(1) Option de style contrat à terme standardisé.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000 %	20/12/2027	$ 5 500	$ 80	0,04
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000	20/12/2027	21 600	87	0,04
				$ 167	0,08

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance		Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	1,250 %	15/09/2031	SGD	1 000	$ (29)	(0,01)
À recevoir	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/09/2031		1 000	113	0,05
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,562	14/02/2024	$	22 300	865	0,42
À payer	CDI BRL à 1 an	5,580	02/01/2025	BRL	10 000	(256)	(0,12)
À payer	CDI BRL à 1 an	6,220	02/01/2025		4 600	(91)	(0,04)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,675	02/01/2023		14 500	94	0,05
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,745	02/01/2025		10 500	156	0,08
À payer	CDI BRL à 1 an	6,950	04/01/2027		8 300	(204)	(0,10)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	8,570	04/01/2027		11 900	254	0,12
À payer	CDI BRL à 1 an	8,615	02/01/2025		6 000	(48)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,120	04/01/2027		2 500	(34)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,206	04/01/2027		9 400	(123)	(0,06)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,446	04/01/2027		28 200	(326)	(0,16)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,665	02/01/2024		5 800	(39)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,755	02/01/2024		22 000	(142)	(0,07)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	10,800	02/01/2024		51 900	325	0,16
À payer	CDI BRL à 1 an	10,833	02/01/2024		31 800	(198)	(0,10)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,995	02/01/2024		15 300	(87)	(0,04)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,055	04/01/2027		22 200	(191)	(0,09)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,065	02/01/2024		10 600	(57)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,148	02/01/2024		2 600	(13)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,170	04/01/2027		24 800	189	0,09
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,920	02/01/2024		99 100	348	0,17
À payer	CDI BRL à 1 an	12,005	02/01/2025		22 100	(57)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,210	02/01/2025		15 500	(30)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,290	02/01/2024		54 800	(211)	(0,10)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,940	04/01/2027		27 000	51	0,03
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	16/03/2027	CNY	35 200	44	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	2,690	24/07/2024	COP	7 257 000	208	0,10
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	2,740	24/07/2024		7 084 900	(202)	(0,10)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,100	26/11/2025		2 651 000	106	0,05
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,060	26/11/2025		14 071 000	490	0,24
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,110	23/03/2026		4 493 200	(150)	(0,07)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,651	26/11/2025		2 624 800	(83)	(0,04)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,050	16/07/2026		34 330 400	(1 185)	(0,59)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,130	26/10/2026		25 320 800	721	0,35
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,885	31/01/2025		24 609 000	425	0,21
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,080	02/02/2027		1 622 900	37	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,090	28/04/2028		1 750 200	43	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,130	31/01/2027		8 865 000	197	0,10
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,130	28/04/2028		618 500	15	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,140	28/04/2028		1 855 800	43	0,02
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,320	31/03/2027		2 908 000	(39)	(0,02)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,560	30/03/2027		4 424 200	(51)	(0,02)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,686	30/03/2027		26 334 600	(283)	(0,14)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,140	28/04/2028		3 977 000	(30)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,640	21/10/2025		11 114 000	(55)	(0,03)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,930	10/11/2025		5 929 100	38	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	12,000	26/11/2025		427 000	(3)	0,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	12,060 %	09/11/2025	COP 4 198 000	$ 30	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,750	16/06/2031	$ 2 500	383	0,19
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,000	16/12/2025	7 900	(968)	(0,47)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,250	17/06/2025	400	(41)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,250	17/06/2030	3 070	(622)	(0,30)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	16/12/2050	1 500	624	0,30
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	16/06/2051	11 300	2 520	1,23
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	21/06/2024	7 100	(261)	(0,13)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	18/12/2024	270	19	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	18/12/2029	4 100	503	0,25
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,750	15/12/2031	2 700	481	0,23
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,250	21/12/2046	1 800	(409)	(0,20)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	5,757	14/04/2026	ZAR 96 300	(363)	(0,18)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	6,665	09/01/2023	20 100	(1)	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	8,500	17/10/2027	63 600	72	0,04
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	0,905	24/11/2023	CLP 1 293 300	128	0,06
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	0,975	03/04/2023	110 000	(6)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,070	07/04/2023	675 000	(39)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,070	10/12/2023	1 218 000	(114)	(0,06)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,080	10/12/2023	1 218 000	(114)	(0,06)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,090	10/12/2023	2 828 000	(265)	(0,13)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,183	27/03/2023	357 900	(19)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,190	19/03/2023	970 000	(54)	(0,03)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,200	27/03/2023	103 400	(6)	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,345	11/06/2025	1 350 000	212	0,10
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,900	01/03/2023	565 000	28	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,947	23/11/2027	999 000	205	0,10
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,950	05/05/2026	1 239 600	(215)	(0,10)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,965	24/11/2027	851 000	173	0,08
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,020	30/04/2026	1 300 000	(226)	(0,11)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,110	01/03/2023	1 030 000	51	0,03
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,120	01/03/2023	1 290 000	64	0,03
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,183	04/12/2027	2 661 000	(506)	(0,25)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,360	22/01/2025	1 099 200	(175)	(0,09)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,640	01/03/2026	795 000	132	0,06
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,530	06/07/2026	1 995 000	290	0,14
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	4,000	06/07/2028	1 019 000	136	0,07
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,130	01/03/2025	1 820 000	139	0,07
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,180	01/10/2028	790 000	36	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,240	01/09/2030	1 286 000	45	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,260	01/03/2026	620 000	41	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,370	01/10/2028	3 136 000	106	0,05
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,470	01/09/2030	460 000	8	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,570	01/10/2028	245 000	5	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,600	12/12/2027	1 803 000	26	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,635	12/12/2027	3 695 000	46	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,720	28/01/2025	4 012 000	271	0,13
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,754	28/01/2025	3 238 000	211	0,10
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,760	28/01/2025	1 933 000	126	0,06
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,915	01/02/2025	3 534 300	213	0,10
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,020	02/03/2029	190 000	2	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,270	02/03/2027	415 700	(3)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,360	25/05/2027	24 600	1	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,386	24/05/2027	1 861 000	24	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,500	12/12/2025	2 564 000	24	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,530	28/01/2023	5 882 000	(210)	(0,10)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,540	28/01/2023	5 621 000	(200)	(0,10)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,560	28/01/2023	14 885 000	(526)	(0,26)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,567	12/12/2025	1 464 000	10	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,570	22/12/2025	1 277 000	7	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,590	22/12/2025	3 565 000	17	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,590	21/03/2027	4 540 300	(28)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,000	27/09/2032	1 785 800	249	0,12
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,690	10/05/2025	7 125 500	(45)	(0,02)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	0,670	28/01/2023	CZK 328 600	464	0,23
À payer[3]	PRIBOR CZK à 6 mois	1,025	29/07/2030	35 800	(199)	(0,10)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,224	28/01/2031	68 900	(790)	(0,39)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,441	28/01/2023	164 100	(174)	(0,08)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,575	26/03/2026	28 100	(153)	(0,07)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,725	22/07/2026	23 800	(154)	(0,07)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	1,815	28/01/2031	34 200	327	0,16
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	2,000	19/06/2024	26 100	(78)	(0,04)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	2,255	15/01/2023	122 200	83	0,04
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	3,490	18/01/2032	10 600	45	0,02
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	3,680	03/03/2027	78 400	147	0,07
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,164	14/03/2027	73 600	107	0,05
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,220	14/03/2027	73 500	98	0,05
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,300	18/03/2027	143 400	(138)	(0,07)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,310	15/03/2027	19 100	22	0,01
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,320	15/03/2027	7 200	8	0,00
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,560	14/07/2032	111 300	258	0,13

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel		Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,606 %	28/06/2027	CZK	54 800	$ 94	0,05
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	15/12/2040	€	300	146	0,07
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028		1 500	71	0,04
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033		2 000	57	0,03
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,500	19/06/2024	HUF	1 427 600	(646)	(0,31)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	1,760	21/01/2030		380 000	437	0,21
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,958	19/03/2026		398 600	(293)	(0,14)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	5,500	04/03/2027		2 382 600	1 125	0,55
À payer	BBR HUF à 6 mois	6,280	18/03/2027		2 363 300	(869)	(0,42)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	13,600	12/12/2024		1 418 700	24	0,01
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	0,250	28/01/2023	PLN	57 900	(461)	(0,22)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	0,770	28/01/2023		28 900	195	0,10
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	1,110	12/01/2031		9 800	743	0,36
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	1,165	28/01/2031		4 400	(178)	(0,09)
À recevoir[3]	WIBOR PLN à 6 mois	1,215	29/07/2030		10 300	384	0,19
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	1,855	28/01/2031		6 000	(380)	(0,18)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	1,933	17/01/2025		11 800	(338)	(0,16)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	3,035	09/12/2026		42 000	1 077	0,53
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	4,075	07/03/2027		28 700	398	0,19
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	4,830	18/03/2027		28 300	(143)	(0,07)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	4,895	17/03/2027		15 000	(102)	(0,05)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	4,920	17/03/2027		15 000	(98)	(0,05)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,300	25/04/2028		11 900	45	0,02
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,670	28/06/2027		14 400	167	0,08
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,725	27/06/2027		20 700	(252)	(0,12)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,843	28/06/2027		1 500	20	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	7,310	30/06/2027		11 000	(197)	(0,10)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,080	16/06/2025	MXN	16 400	(85)	(0,04)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,700	12/09/2030		35 400	(309)	(0,15)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,770	09/10/2030		150 700	1 297	0,63
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,850	19/08/2030		12 100	(100)	(0,05)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,875	16/08/2030		16 800	(137)	(0,07)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,880	16/08/2030		8 700	(71)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,920	16/08/2030		9 100	(73)	(0,04)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,240	10/07/2026		156 300	(603)	(0,29)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,383	30/08/2040		23 200	259	0,13
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,480	28/05/2040		16 700	(61)	(0,03)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,495	17/07/2026		140 500	562	0,27
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,505	17/07/2026		102 100	406	0,20
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,520	03/08/2040		5 700	60	0,03
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,520	06/08/2040		8 100	85	0,04
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,533	03/08/2040		10 900	114	0,06
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,580	01/01/2025		29 700	(95)	(0,05)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,580	03/08/2040		6 000	61	0,03
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,830	27/12/2029		19 900	(102)	(0,05)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,845	02/07/2026		118 100	312	0,15
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,570	19/11/2026		145 200	(480)	(0,23)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,675	04/06/2029		65 100	(177)	(0,09)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,465	16/08/2027		167 300	130	0,06
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,480	24/03/2027		121 900	(125)	(0,06)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,700	05/11/2027		8 700	(3)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,743	05/11/2027		37 900	(8)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,760	05/11/2027		25 400	(5)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,773	05/11/2027		37 600	(6)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,045	04/11/2027		17 200	7	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,053	04/11/2027		18 900	8	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,117	04/11/2027		47 100	25	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,165	05/11/2026		25 600	9	0,00
						$ 4 581	2,23
Total des Instruments financiers dérivés compensés						**$ 4 748**	**2,31**

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

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

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

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

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

OPTIONS ACHETÉES

OPTIONS DE CHANGE

Contrepartie	Description	Prix d'exercice		Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - EUR contre CZK hors cote	CZK	23,830	01/11/2023	802	$ 84	$ 152	0,07
GLM	Option de vente - EUR contre HUF hors cote	HUF	385,000	01/11/2023	203	27	29	0,01
	Option de vente - EUR contre PLN hors cote	PLN	4,560	01/11/2023	806	89	123	0,06
JPM	Option d'achat - AUD contre USD hors cote	$	0,735	04/05/2023	909	55	91	0,04
	Option de vente - EUR contre HUF hors cote	HUF	385,000	01/11/2023	403	38	57	0,03
MBC	Option de vente - USD contre MXN hors cote	MXN	18,310	04/05/2023	550	55	40	0,02
MYI	Option de vente - USD contre BRL hors cote	BRL	4,450	04/05/2023	535	53	16	0,01
	Option de vente - USD contre ZAR hors cote	ZAR	15,925	04/05/2023	535	54	96	0,05
						$ 455	$ 604	0,29

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067 %	09/06/2023	800	$ (10)	$ (2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	800	(11)	(26)	(0,01)
							$ (21)	$ (28)	(0,01)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement brésilien	(1,000) %	20/12/2024	$ 1 800	$ 27	$ (22)	$ 5	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement brésilien	(1,000)	20/12/2024	1 000	16	(13)	3	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement mexicain	(1,000)	20/12/2024	100	(1)	0	(1)	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement mexicain	(1,000)	20/12/2024	2 000	(23)	9	(14)	(0,01)
HUS	Obligation internationale du gouvernement mexicain	(1,000)	20/12/2024	1 100	(13)	5	(8)	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement brésilien	(1,000)	20/12/2024	3 200	63	(53)	10	0,01
					$ 69	$ (74)	$ (5)	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[2]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement du Monténégro	1,000 %	20/06/2023	€ 500	$ (39)	$ 32	$ (7)	0,00
BPS	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	$ 200	0	0	0	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	4 800	(458)	171	(287)	(0,14)
BRC	Obligation internationale du gouvernement argentin	5,000	20/12/2023	4 400	(673)	127	(546)	(0,27)
JPM	Obligation internationale du gouvernement nigérian	1,000	20/06/2023	600	(14)	5	(9)	(0,01)
					$ (1 184)	$ 335	$ (849)	(0,42)

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

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

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

SWAPS SUR DEVISES CROISÉES

Contrepartie	À recevoir	À payer	Date d'échéance	Montant notionnel de la devise reçue	Montant notionnel de la devise livrée	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	Taux variable égal à LIBOR USD à 6 mois plus 0,282 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR ARS à 6 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	07/06/2027	$ 100	ARS 4 488	$ 0	$ 93	$ 93	0,04

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750 %	15/06/2027	MYR 21 600	$ (38)	$ 41	$ 3	0,00
BPS	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	2,670	16/06/2026	10 600	0	(84)	(84)	(0,04)
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	1,890	18/09/2029	THB 52 800	0	(44)	(44)	(0,02)
CBK	À payer	THBFIX THB à 6 mois	1,050	18/03/2027	73 000	0	(97)	(97)	(0,05)
GST	À payer	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,500	21/09/2027	553 000	(209)	426	217	0,11
JPM	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,020	06/06/2024	CLP 770 000	0	(72)	(72)	(0,04)
MYC	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,000	15/12/2026	MYR 13 400	3	81	84	0,04
MYI	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	3,340	18/09/2029	3 500	0	(27)	(27)	(0,01)
SCX	À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,430	06/03/2025	CNY 25 600	0	1	1	0,00
	À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	3,020	04/02/2025	26 000	0	28	28	0,01
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	2,750	15/09/2026	MYR 3 700	11	(40)	(29)	(0,01)
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,230	23/08/2024	6 500	0	11	11	0,01
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000	21/09/2027	THB 370 000	16	83	99	0,05
	À recevoir	THBFIX THB à 6 mois	1,209	15/01/2025	199 300	0	70	70	0,03
UAG	À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,920	15/01/2025	CNY 43 900	0	78	78	0,04
						$ (217)	$ 455	$ 238	0,12

SWAPS DE VOLATILITÉ

Contrepartie	Volatilité à payer/à recevoir	Entité de référence	Taux d'exercice de volatilité	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	À payer	Volatilité réalisée au cours USD contre JPY à 1 an[1]	12,025 %	20/06/2023	$ 34	$ 0	$ 0	$ 0	0,00

[1] Swap de variance

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	THB	39 834	$	1 149	$ 0	$ (3)	$ (3)	0,00
BOA	01/2023	CNH	44 408		6 882	455	0	455	0,22
	01/2023	HUF	2 234 407		5 703	0	(252)	(252)	(0,12)
	01/2023	¥	2 512 000		17 615	0	(1 435)	(1 435)	(0,70)
	01/2023	MYR	18 800		4 238	0	(30)	(30)	(0,01)
	01/2023	PLN	269		61	0	0	0	0,00
	01/2023	RON	22		4	0	0	0	0,00
	01/2023	$	13 583	MYR	60 245	93	0	93	0,05
	01/2023		41	PLN	181	0	0	0	0,00
	02/2023	CAD	1 570	$	1 154	0	(5)	(5)	0,00
	02/2023	€	3 017		3 206	0	(23)	(23)	(0,01)
	02/2023	£	2 167		2 557	0	(53)	(53)	(0,03)
	02/2023	¥	1 523 800		10 450	0	(1 158)	(1 158)	(0,56)
	02/2023	$	6 875	CNH	44 408	0	(432)	(432)	(0,21)
	02/2023		368	EGP	8 142	0	(59)	(59)	(0,03)
	02/2023		6 078	€	5 735	60	0	60	0,03
	02/2023		238	¥	31 200	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023		888	NOK	8 816	8	0	8	0,00
	03/2023	ZAR	403	$	23	0	(1)	(1)	0,00
	07/2023	INR	368 549		4 581	191	0	191	0,09
	07/2023	$	4 572	INR	368 549	0	(182)	(182)	(0,09)
BPS	01/2023	BRL	11 960	$	2 200	0	(65)	(65)	(0,03)
	01/2023	HUF	1 673 567		4 332	0	(128)	(128)	(0,06)
	01/2023	MYR	27 351		6 177	0	(32)	(32)	(0,02)
	01/2023	$	6 791	CNH	44 408	0	(365)	(365)	(0,18)
	01/2023		135	ILS	463	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023		6 179	MYR	27 351	75	0	75	0,04
	01/2023		12	THB	401	0	0	0	0,00
	02/2023	€	16 971	$	17 598	0	(567)	(567)	(0,28)
	02/2023	ILS	10 949		3 254	147	0	147	0,07
	03/2023	CLP	4 690 457		4 857	0	(589)	(589)	(0,29)
	03/2023	COP	31 852 643		6 384	7	(105)	(98)	(0,05)
	03/2023	MXN	128 503		6 376	0	(128)	(128)	(0,06)
	03/2023	PEN	4 439		1 149	0	(7)	(7)	0,00
	03/2023	TWD	664		22	0	0	0	0,00
	03/2023	$	4 530	MXN	88 892	0	(31)	(31)	(0,02)
	03/2023		13	TWD	404	0	0	0	0,00
	04/2023		131	ZAR	2 355	6	0	6	0,00
BRC	01/2023	CZK	5 574	$	236	0	(10)	(10)	(0,01)
	01/2023	HUF	18 908		43	0	(8)	(8)	0,00
	01/2023	MYR	30 673		6 777	0	(239)	(239)	(0,12)
	01/2023	PEN	17 378		4 479	0	(68)	(68)	(0,03)
	01/2023	PLN	276		55	0	(8)	(8)	0,00
	01/2023	$	233	CNH	1 627	2	0	2	0,00
	01/2023		5 603	MYR	26 375	430	0	430	0,21

Tableau des investissements Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	01/2023	$	98	PHP	5 452	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023		135	PLN	601	2	0	2	0,00
	01/2023		3 605	SGD	4 855	16	0	16	0,01
	02/2023	£	3 303	$	4 070	92	0	92	0,04
CBK	01/2023	CLP	7 787 302		8 754	0	(380)	(380)	(0,19)
	01/2023	HUF	2 308 811		5 787	0	(349)	(349)	(0,17)
	01/2023	PEN	6 800		1 693	0	(86)	(86)	(0,04)
	01/2023	PLN	2 167		468	0	(25)	(25)	(0,01)
	01/2023	$	8 170	CLP	7 784 676	961	0	961	0,47
	01/2023		205	PLN	976	18	0	18	0,01
	02/2023	AUD	55	$	37	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	EGP	8 142		323	14	0	14	0,01
	02/2023	PEN	5 360		1 359	0	(41)	(41)	(0,02)
	02/2023	$	7 285	BRL	39 315	121	0	121	0,06
	02/2023		8 754	CLP	7 830 195	386	0	386	0,19
	02/2023		4 745	£	3 857	0	(100)	(100)	(0,05)
	02/2023	ZAR	7 435	$	427	0	(8)	(8)	0,00
	03/2023	COP	479 490		100	2	0	2	0,00
	03/2023	MXN	30 534		1 520	0	(28)	(28)	(0,01)
	03/2023	PEN	7 977		2 034	0	(45)	(45)	(0,02)
	03/2023	$	13 778	MXN	270 304	0	(98)	(98)	(0,05)
	03/2023		94	PEN	377	4	0	4	0,00
	03/2023		209	UYU	8 254	0	(5)	(5)	0,00
	04/2023	PEN	45 366	$	11 322	0	(473)	(473)	(0,23)
	05/2023	ILS	8 527		2 518	84	0	84	0,04
	05/2023	MXN	238		12	0	0	0	0,00
	05/2023	PEN	3 123		790	0	(20)	(20)	(0,01)
	07/2023	ILS	20 381		5 868	15	0	15	0,01
CLY	01/2023	HUF	346 900		882	0	(43)	(43)	(0,02)
	01/2023	MYR	14 044		2 991	0	(221)	(221)	(0,11)
	11/2023	€	443	HUF	205 188	25	0	25	0,01
DUB	01/2023	DKK	19 473	$	2 745	0	(51)	(51)	(0,03)
	01/2023	TRY	46 814		2 288	0	(194)	(194)	(0,09)
	01/2023	$	5 420	HUF	2 450 731	1 094	0	1 094	0,53
	03/2023	COP	23 306 933	$	4 681	0	(61)	(61)	(0,03)
	03/2023	$	2 250	COP	10 393 012	0	(135)	(135)	(0,07)
GLM	01/2023	COP	57 664 556	$	11 895	17	0	17	0,01
	01/2023	HUF	600		2	0	0	0	0,00
	01/2023	¥	1 642 000		11 996	0	(457)	(457)	(0,22)
	01/2023	MYR	9 660		2 086	0	(124)	(124)	(0,06)
	01/2023	PLN	22 862		4 533	0	(676)	(676)	(0,33)
	01/2023	$	2 244	BRL	11 960	21	0	21	0,01
	01/2023		243	CNH	1 689	2	0	2	0,00
	01/2023		2 240	CZK	55 425	208	0	208	0,10
	01/2023		3 809	MYR	17 831	269	0	269	0,13
	01/2023		4 346	PEN	17 481	228	0	228	0,11
	01/2023		197	PLN	917	12	0	12	0,01
	01/2023		5 282	THB	184 090	41	0	41	0,02
	02/2023	COP	35 665 213	$	7 047	0	(242)	(242)	(0,12)
	02/2023	DOP	76 373		1 382	33	0	33	0,02
	02/2023	$	3 415	COP	15 556 605	0	(236)	(236)	(0,12)
	03/2023	COP	5 844 557	$	1 212	22	0	22	0,01
	03/2023	MXN	168 733		8 284	0	(256)	(256)	(0,12)
	03/2023	$	1 632	CLP	1 486 898	97	0	97	0,05
	03/2023		12 946	COP	63 509 113	0	(23)	(23)	(0,01)
	04/2023	BRL	11 960	$	2 205	0	(21)	(21)	(0,01)
	04/2023	DOP	81 364		1 479	59	0	59	0,03
	05/2023	$	14 053	PEN	55 953	465	0	465	0,23
IND	06/2024		815	TWD	20 969	0	(94)	(94)	(0,05)
JPM	01/2023	HUF	42	$	0	0	0	0	0,00
	01/2023	$	2 905	CNY	20 218	23	0	23	0,01
	01/2023		2 330	TRY	44 334	20	0	20	0,01
	02/2023	NOK	11 325	$	1 144	0	(7)	(7)	0,00
	02/2023	$	393	TWD	11 945	0	(3)	(3)	0,00
	03/2023		5 217	CNY	36 092	30	0	30	0,01
	03/2023		6 098	IDR	95 446 772	72	0	72	0,04
	06/2023		1 504	VND	36 096 000	2	0	2	0,00
	11/2023	HUF	205 375	€	443	0	(25)	(25)	(0,01)
MBC	01/2023	DKK	17 664	$	2 495	0	(41)	(41)	(0,02)
	01/2023	$	55	PLN	279	9	0	9	0,00
	02/2023	¥	26 800	$	193	0	(11)	(11)	(0,01)
	02/2023	MXN	1 833		89	0	(4)	(4)	0,00
	02/2023	$	1 093	CAD	1 449	0	(24)	(24)	(0,01)
	02/2023		6 503	ZAR	117 923	404	0	404	0,20
	03/2023	MXN	39 648	$	1 973	0	(40)	(40)	(0,02)
	03/2023	$	3 000	COP	13 689 104	0	(214)	(214)	(0,10)
	03/2023		3 701	IDR	57 931 255	44	0	44	0,02
	03/2023		22	ZAR	403	1	0	1	0,00
	05/2023	CNH	8 536	$	1 272	26	0	26	0,01
MYI	01/2023	MYR	17 741		3 761	0	(297)	(297)	(0,14)
	01/2023	PLN	1 120		237	0	(18)	(18)	(0,01)
	01/2023	$	2 139	CZK	52 988	201	0	201	0,10

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	01/2023	$	8	€	7	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023		6 036	MYR	27 912	349	0	349	0,17
	01/2023		74	PLN	368	10	0	10	0,00
	02/2023	MXN	1 393	$	71	0	0	0	0,00
	02/2023	$	724	TWD	22 084	0	(3)	(3)	0,00
	02/2023	ZAR	218 748	$	12 450	0	(361)	(361)	(0,18)
	03/2023	MXN	43 665		2 207	0	(3)	(3)	0,00
	03/2023	$	5 205	IDR	81 624 118	72	0	72	0,04
	04/2023		302	ZAR	5 255	4	0	4	0,00
	04/2023	ZAR	32 445	$	1 748	0	(143)	(143)	(0,07)
RBC	01/2023	PLN	271		59	0	(3)	(3)	0,00
	02/2023	$	1 347	NOK	13 442	20	0	20	0,01
	03/2023		5 857	MXN	117 135	78	0	78	0,04
	04/2023	MXN	47 739	$	2 303	0	(99)	(99)	(0,05)
SCX	01/2023	KRW	10 309		8	0	0	0	0,00
	01/2023	MYR	23 452		5 302	0	(38)	(38)	(0,02)
	01/2023	$	3 185	MYR	14 094	38	0	38	0,02
	01/2023	ZMW	686	$	38	0	0	0	0,00
	02/2023	TWD	54 385		1 768	0	(10)	(10)	(0,01)
	02/2023	$	239	€	231	8	0	8	0,00
	04/2023		106	ZAR	1 843	2	0	2	0,00
SOG	01/2023	RON	222	$	44	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	SGD	4 633		3 421	0	(34)	(34)	(0,02)
	04/2023	$	116	ZAR	2 016	2	0	2	0,00
SSB	01/2023		11 248	COP	57 664 556	630	0	630	0,31
TOR	02/2023		2 422	ZAR	43 933	151	0	151	0,07
UAG	01/2023	CZK	104 341	$	4 466	0	(142)	(142)	(0,07)
	01/2023	HUF	1		0	0	0	0	0,00
	01/2023	TRY	107 611		5 293	0	(405)	(405)	(0,20)
	01/2023	$	2 028	CZK	51 588	250	0	250	0,12
	01/2023		35	HUF	13 687	2	0	2	0,00
	02/2023	CNH	44 408	$	6 907	464	0	464	0,23
						$ 8 694	$ (12 410)	$ (3 716)	(1,81)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (partiellement couverte) de capitalisation et E en EUR (partiellement couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	€	5 815	$	6 195	$ 0	$ (14)	$ (14)	(0,01)
BOA	01/2023	MXN	65		3	0	0	0	0,00
BPS	01/2023	CNY	4 023		579	0	(3)	(3)	0,00
CBK	01/2023		2 597		372	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	€	2 221		2 364	0	(7)	(7)	(0,01)
	01/2023	IDR	5 117 447		325	0	(7)	(7)	0,00
	01/2023	THB	5 609		161	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	33	CNY	235	1	0	1	0,00
	01/2023		147	€	138	1	0	1	0,00
	01/2023		3	MXN	65	0	0	0	0,00
	02/2023	MXN	65	$	3	0	0	0	0,00
GLM	01/2023	BRL	470		85	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	$	89	BRL	470	0	0	0	0,00
	01/2023		434	RON	2 052	8	0	8	0,00
	02/2023	BRL	470	$	88	0	0	0	0,00
JPM	01/2023	$	391	TRY	8 043	36	0	36	0,02
MBC	01/2023	€	42	$	45	0	0	0	0,00
	01/2023	$	36 896	€	35 174	659	0	659	0,32
	01/2023		229	£	188	0	(3)	(3)	0,00
SCX	01/2023	TRY	805	$	43	0	0	0	0,00
	01/2023	$	3 528	CNY	25 186	118	0	118	0,06
	01/2023		24 134	€	23 187	623	0	623	0,30
SOG	01/2023		3 812	PLN	17 262	122	0	122	0,06
UAG	01/2023	€	6 711	$	7 164	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	IDR	3 956		0	0	0	0	0,00
	01/2023	PLN	4 458		1 009	0	(7)	(7)	0,00
	01/2023	RON	448		97	0	0	0	0,00
	01/2023	TRY	955		51	0	0	0	0,00
	01/2023	$	718	THB	25 281	12	0	12	0,01
						$ 1 580	$ (50)	$ 1 530	0,75

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (partiellement couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	33	£	27	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	02/2023		5	TRY	86	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	IDR	50 271	$	3	0	0	0	0,00
	01/2023	$	0	CNY	2	0	0	0	0,00
GLM	01/2023		34	PLN	156	1	0	1	0,00
JPM	01/2023		298	£	246	0	(1)	(1)	0,00
MBC	01/2023		30	€	29	1	0	1	0,00
	01/2023		6	£	5	0	0	0	0,00
MYI	01/2023		1	TRY	11	0	0	0	0,00
SCX	01/2023		31	CNY	221	1	0	1	0,00
TOR	01/2023		185	£	154	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	IDR	46	$	0	0	0	0	0,00
	01/2023	$	6	THB	224	0	0	0	0,00
						$ 3	$ (2)	$ 1	0,00
Total des Instruments financiers dérivés hors cote								**$ (2 132)**	**(1,04)**

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CERTIFICATS DE DÉPÔT				
Bancolombia S.A.				
2,860 % éch. 25/02/2024	COP	500 000	$ 96	0,05
12,021 % éch. 04/08/2023		200 000	41	0,02
Total des Certificats de dépôt			**$ 137**	**0,07**
Total des Investissements			**$ 200 553**	**97,77**
Autres actifs et passifs à court terme			**$ 4 578**	**2,23**
Actif net			**$ 205 131**	**100,00**

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

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

(d) Affilié au Fonds.

(e) Titre convertible conditionnel.

Un montant en numéraire de 4 974 $ (31 décembre 2021 : 4 853 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 1 314 $) et un montant en numéraire de 5 521 $ (31 décembre 2021 : 400 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 180 287	$ 1 313	$ 181 600
Fonds d'investissement	14 173	624	0	14 797
Contrats de mise en pension	0	706	0	706
Instruments financiers dérivés[3]	126	3 194	(7)	3 313
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	0	137	137
Totaux	**$ 14 299**	**$ 184 811**	**$ 1 443**	**$ 200 553**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 260 774	$ 4 484	$ 265 258
Fonds d'investissement	15 188	0	0	15 188
Contrats de mise en pension	0	688	0	688
Instruments financiers dérivés[3]	212	4 425	(27)	4 610
Totaux	**$ 15 400**	**$ 265 887**	**$ 4 457**	**$ 285 744**

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

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

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ (17)	$ 0	$ (17)	$ S/O	$ S/O	$ S/O
BOA	(2 672)	2 460	(212)	1 621	(1 870)	(249)
BPS	(2 204)	1 480	(724)	622	(370)	252
BRC	(334)	510	176	(337)	645	308
BSS	S/O	S/O	S/O	61	0	61
CBK	(169)	10	(159)	(3)	0	(3)
CLY	(239)	0	(239)	S/O	S/O	S/O
DUB	653	(650)	3	15	0	15
GLM	(338)	440	102	1 060	(830)	230
GST	203	(260)	(57)	(31)	0	(31)
HUS	(8)	0	(8)	188	(280)	(92)
IND	(94)	340	246	5	0	5
JPM	224	0	224	899	(960)	(61)
MBC	847	(804)	43	S/O	S/O	S/O
MYC	84	0	84	(207)	260	53
MYI	(104)	281	177	872	(810)	62
RBC	(4)	0	(4)	712	(370)	342
SCX	922	(790)	132	676	(340)	336
SOG	86	0	86	S/O	S/O	S/O
SSB	630	(630)	0	S/O	S/O	S/O
TOR	151	0	151	S/O	S/O	S/O
UAG	251	(420)	(169)	(607)	809	202

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	54,96	60,12
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	32,75	30,48
Autres valeurs mobilières	0,83	0,71
Fonds d'investissement	7,21	5,23
Contrats de mise en pension	0,34	0,24
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,34	0,07
Instruments financiers dérivés compensés	2,31	(0,39)
Instruments financiers dérivés hors cote	(1,04)	1,91
Certificats de dépôt	0,07	S/O

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Argentine	0,49	0,51
Australie	S/O	0,60
Autriche	S/O	0,33
Bahamas	0,37	0,47
Biélorussie	0,08	0,14
Bermudes	S/O	0,42
Brésil	2,65	3,36
Îles Caïmans	0,70	1,63
Chili	S/O	4,27
Chine	0,02	0,09
Colombie	S/O	0,85
Congo	0,27	S/O
Costa Rica	S/O	0,09
Danemark	2,08	2,09
République dominicaine	1,52	1,04
Équateur	S/O	1,14
Égypte	S/O	1,40
France	S/O	0,35
Allemagne	S/O	0,61
Ghana	0,48	0,42
Guatemala	S/O	0,15
Hong Kong	S/O	0,53
Inde	S/O	0,91
Irlande	3,14	3,38
Israël	2,82	1,30

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Italie	S/O	0,55
Côte d'Ivoire	0,45	
		0,93
Japon	S/O	0,19
Jersey, Îles Anglo-Normandes	1,29	
		S/O
Jordanie	S/O	0,87
Kazakhstan	S/O	0,38
Luxembourg	1,19	
		3,20
Île Maurice	S/O	0,18
Mexique	4,32	
		4,17
Maroc	S/O	0,28
Pays-Bas	2,16	
		1,53
Nigeria	S/O	0,71
Norvège	S/O	0,19
Oman	S/O	0,55
Pakistan	S/O	0,21
Paraguay	S/O	0,16
Pérou	3,18	
		3,76
Pologne	1,16	
		S/O
Roumanie	S/O	1,92
Russie	0,05	
		S/O
Arabie saoudite	S/O	0,67
Serbie	0,05	
		0,69
Singapour	S/O	4,24
Afrique du Sud	5,04	
		5,31
Sri Lanka	S/O	0,19
Suède	S/O	0,21
Suisse	S/O	0,37
Thaïlande	S/O	1,00
Tunisie	0,09	
		S/O
Turquie	0,91	
		1,30
Ukraine	S/O	1,20
Émirats arabes unis	0,26	
		1,65
Royaume-Uni	1,36	
		2,26
États-Unis	20,18	
		13,26
Ouzbékistan	0,62	
		S/O
Îles Vierges britanniques	1,24	
		0,90
Zambie	S/O	0,67
Instruments à court terme	30,37	
		11,53
Fonds d'investissement	7,21	
		5,23
Contrats de mise en pension	0,34	
		0,24
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,34	
		0,07
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	S/O	0,01
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,08	
		0,00
Swaps de taux d'intérêt	2,23	
		(0,40)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Options de change	0,29	
		0,09
Options vendues		
Options de change	S/O	(0,04)
Swaptions de taux d'intérêt	(0,01)	
		S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	0,00	
		0,01
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,42)	
		(0,35)
Swaps sur devises croisées	0,04	
		0,03
Swaps de taux d'intérêt	0,12	
		0,02
Swaps de volatilité	0,00	
		0,02
Contrats de change à terme	(1,81)	
		1,39
Contrats de change à terme couverts	0,75	
		0,74
Certificats de dépôt	0,07	
		S/O
Autres actifs et passifs à court terme	2,23	
		1,63
Actif net	100,00	
		100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
ARGENTINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement argentin				
0,500 % éch. 09/07/2030	$	99	$ 23	0,11
1,500 % éch. 09/07/2035		105	24	0,11
Total Argentine			47	0,22
AZERBAÏDJAN				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC				
7,230 % éch. 17/03/2026		200	195	0,93
BRÉSIL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				
0,000 % éch. 30/01/2023 (b)(e)		23	0	0,00
Oi S.A.				
0,000 % éch. 25/02/2035	BRL	50	43	0,20
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL				
9,850 % éch. 16/07/2032		2 638	441	2,11
Vale S.A.				
0,000 % (e)		1 490	105	0,50
Total Brésil			589	2,81
ÎLES CAÏMANS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Interoceanica Finance Ltd.				
0,000 % éch. 30/11/2025 (b)	$	18	15	0,07
Odebrecht Drilling Norbe Ltd. (6,350 % en numéraire et 1,000 % de rémunération en nature)				
7,350 % éch. 01/12/2026 ^(a)		52	29	0,14
Total Îles Caïmans			44	0,21
CHILI				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos				
6,000 % éch. 01/01/2043	CLP	5 000	7	0,03
CHINE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Flourish Century				
6,600 % éch. 04/02/2049 ^(h)	$	200	22	0,11
COLOMBIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Empresas Publicas de Medellin ESP				
7,625 % éch. 10/09/2024	COP	540 000	100	0,48
8,375 % éch. 08/11/2027		489 000	76	0,36
			176	0,84
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
TES colombien				
6,250 % éch. 09/07/2036		197 100	23	0,11
9,250 % éch. 28/05/2042		730 000	109	0,52
Financiera de Desarrollo Territorial S.A. Findeter				
7,875 % éch. 12/08/2024		12 000	2	0,01
République de Colombie				
1,000 % éch. 26/11/2025		252 300	45	0,22
1,000 % éch. 26/08/2026		238 100	42	0,20
1,000 % éch. 03/11/2027		102 000	16	0,08
1,000 % éch. 09/07/2036		25 000	3	0,01
			240	1,15
Total Colombie			416	1,99
RÉPUBLIQUE TCHÈQUE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de République tchèque				
2,500 % éch. 25/08/2028	CZK	4 600	177	0,85
DANEMARK				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Jyske Realkredit A/S				
1,500 % éch. 01/10/2053	DKK	237	$ 26	0,12
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
1,000 % éch. 01/10/2050		53	6	0,03
1,500 % éch. 01/10/2053		109	11	0,05
Nykredit Realkredit A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050		599	63	0,30
1,000 % éch. 01/10/2053		20	2	0,01
1,500 % éch. 01/10/2053		2 067	225	1,08
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050		222	24	0,12
1,500 % éch. 01/10/2053		347	38	0,18
Total Danemark			395	1,89
RÉPUBLIQUE DOMINICAINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Billets de la Banque centrale de la République dominicaine				
12,000 % éch. 03/10/2025	DOP	3 800	65	0,31
HONGRIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Banque de développement hongroise				
0,375 % éch. 09/06/2026	€	100	88	0,42
Obligation internationale du gouvernement hongrois				
5,000 % éch. 22/02/2027		100	106	0,51
Total Hongrie			194	0,93
INDONÉSIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement indonésien				
6,375 % éch. 15/08/2028	IDR	15 000	1	0,00
IRLANDE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Black Diamond CLO DAC				
2,316 % éch. 20/01/2032	€	96	101	0,49
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
2,548 % éch. 15/11/2031		100	103	0,49
Harvest CLO DAC				
2,775 % éch. 26/06/2030		97	101	0,48
			305	1,46
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Alfa Bank AO Via Alfa Bond Issuance PLC				
9,350 % éch. 06/08/2022 ^	RUB	33 000	13	0,06
Total Irlande			318	1,52
ISRAËL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Leviathan Bond Ltd.				
6,125 % éch. 30/06/2025	$	100	98	0,47
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement israélien				
0,150 % éch. 31/07/2023	ILS	400	111	0,53
1,500 % éch. 30/11/2023		500	139	0,66
4,250 % éch. 31/03/2023		300	85	0,41
			335	1,60
Total Israël			433	2,07
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Corsair International Ltd.				
5,473 % éch. 28/01/2027	€	100	106	0,51
LUXEMBOURG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
5,250 % éch. 23/05/2023 ^(g)	$	200	27	0,13
ÎLE MAURICE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Greenko Solar Mauritius Ltd.				
5,950 % éch. 29/07/2026	$	200	$ 183	0,87
MEXIQUE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Urbi Desarrollos Urbanos S.A.B. de C.V.				
8,790 % éch. 09/12/2014 ^	MXN	5 000	0	0,00
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement mexicain				
7,500 % éch. 03/06/2027		4 700	227	1,08
7,750 % éch. 29/05/2031		1 300	62	0,30
8,500 % éch. 31/05/2029		500	25	0,12
10,000 % éch. 20/11/2036		480	26	0,12
			340	1,62
Total Mexique			340	1,62
PAYS-BAS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Republic of Angola Via Avenir BV				
9,687 % éch. 07/12/2023	$	10	10	0,05
PÉROU				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % éch. 17/09/2024	PEN	1 230	301	1,44
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Fondo MIVIVIENDA S.A.				
7,000 % éch. 14/02/2024		130	34	0,16
Total Pérou			335	1,60
POLOGNE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement polonais				
1,250 % éch. 25/10/2030	PLN	150	23	0,11
2,750 % éch. 25/10/2029		300	54	0,26
Total Pologne			77	0,37
QATAR				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nakilat, Inc.				
6,067 % éch. 31/12/2033	$	92	95	0,45
AFRIQUE DU SUD				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banque de développement d'Afrique du Sud				
8,600 % éch. 21/10/2024 (h)	ZAR	3 200	185	0,88
Eskom Holdings SOC Ltd.				
7,850 % éch. 02/04/2026		5 000	280	1,34
			465	2,22
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement sud-africain				
2,000 % éch. 31/01/2025 (d)		2 546	146	0,70
10,500 % éch. 21/12/2026		3 600	223	1,07
			369	1,77
Total Afrique du Sud			834	3,99
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Lloyds Banking Group PLC				
4,716 % éch. 11/08/2026	$	200	196	0,93
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Harbour Energy PLC				
3,944 % éch. 28/01/2054	£	100	115	0,55
Total Royaume-Uni			311	1,48

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÉTATS-UNIS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
5,094 % éch. 25/01/2035	$	34	$ 33	0,16
Citigroup Mortgage Loan Trust				
4,449 % éch. 25/07/2045		7	5	0,02
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,869 % éch. 25/02/2037		50	48	0,23
5,514 % éch. 25/11/2035		60	58	0,28
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				
4,509 % éch. 25/11/2036		2	1	0,01
Fieldstone Mortgage Investment Trust				
4,769 % éch. 25/05/2036		78	54	0,26
GSAMP Trust				
4,479 % éch. 25/01/2037		48	29	0,14
Home Equity Asset Trust				
4,989 % éch. 25/11/2032		4	3	0,01
HSI Asset Loan Obligation Trust				
4,136 % éch. 25/12/2036		2	1	0,01
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
4,449 % éch. 25/05/2037		3	2	0,01
5,154 % éch. 25/01/2035		23	21	0,10
5,184 % éch. 25/03/2034		49	47	0,22
Morgan Stanley Dean Witter Capital, Inc. Trust				
5,739 % éch. 25/02/2033		16	16	0,08
New Century Home Equity Loan Trust				
4,749 % éch. 25/05/2036		8	8	0,04
Saxon Asset Securities Trust				
4,699 % éch. 25/09/2037		12	11	0,05
Soundview Home Loan Trust				
4,469 % éch. 25/06/2037		4	3	0,01
4,559 % éch. 25/07/2037		61	51	0,24
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
4,609 % éch. 25/10/2037		141	95	0,45
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				
4,629 % éch. 25/05/2037		51	42	0,20
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust				
3,816 % éch. 25/10/2036		4	1	0,01
			529	2,53
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Rio Oil Finance Trust				
9,250 % éch. 06/07/2024		193	196	0,93
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Banc of America Mortgage Trust				
3,679 % éch. 25/07/2034		1	1	0,01
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,255 % éch. 25/05/2047 ^		6	5	0,02
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,367 % éch. 25/04/2037		196	146	0,70
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				
5,219 % éch. 26/12/2046 ^	$	14	$ 10	0,05
Citigroup Mortgage Loan Trust				
3,871 % éch. 25/09/2037 ^		84	72	0,34
4,459 % éch. 25/01/2037		2	2	0,01
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				
3,875 % éch. 25/08/2035		3	2	0,01
GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates				
3,726 % éch. 25/10/2033		1	1	0,01
IndyMac Mortgage Loan Trust				
3,141 % éch. 25/11/2037		72	59	0,28
3,837 % éch. 25/12/2034		3	3	0,01
5,029 % éch. 25/07/2045		28	24	0,11
Lehman XS Trust				
4,769 % éch. 25/09/2046		115	96	0,46
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
2,644 % éch. 25/10/2037		47	41	0,20
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
6,000 % éch. 25/10/2036		3	3	0,01
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,266 % éch. 25/02/2037 ^		7	6	0,03
			471	2,25
Total États-Unis			1 196	5,71
ZAMBIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement zambien				
12,000 % éch. 22/03/2028	ZMW	400	14	0,07
15,000 % éch. 16/02/2027		300	12	0,06
Total Zambie			26	0,13
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BILLETS DE TRÉSORERIE				
Crown Castle International Corp.				
5,000 % éch. 04/01/2023	$	250	250	1,19
Dominion Resources, Inc.				
4,700 % éch. 01/02/2023		250	249	1,19
Électricité de France S.A.				
5,000 % éch. 20/01/2023		250	249	1,19
Energy Transfer Partners LP				
5,080 % éch. 05/01/2023		250	250	1,19
Entergy Corp.				
4,700 % éch. 12/01/2023		250	250	1,19
Fiserv, Inc.				
4,780 % éch. 23/01/2023		250	249	1,19
Hitachi America Capital Ltd.				
4,700 % éch. 04/01/2023		250	250	1,19
Walgreens Boots Alliance, Inc.				
4,950 % éch. 18/01/2023		250	249	1,19
			1 996	9,52
BONS DU TRÉSOR HONGROIS				
18,250 % éch.				
03/01/2023 (b)(c)	HUF	242 000	$ 645	3,08
BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN				
0,455 % éch.				
08/02/2023 (b)(c)	ILS	2 100	593	2,83
0,860 % éch.				
03/05/2023 (b)(c)		1 600	448	2,14
			1 041	4,97
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS				
(0,251) % éch.				
11/01/2023 (b)(c)	¥	58 900	446	2,13
(0,235) % éch.				
11/01/2023 (b)(c)		46 800	355	1,70
(0,201) % éch.				
16/01/2023 (b)(c)		249 000	1 887	9,00
(0,190) % éch.				
16/01/2023 (b)(c)		101 000	766	3,66
			3 454	16,49
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
3,642 % éch.				
17/01/2023 (b)(c)	$	100	100	0,48
4,397 % éch.				
23/03/2023 (b)(c)		1 600	1 585	7,57
			1 685	8,05
Total des Instruments à court terme			8 821	42,11
Total des Valeurs mobilières			**$ 15 264**	**72,89**

ACTIONS

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	436	4	0,02
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (f)	15 103	201	0,96
		205	0,98
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (f)	18 700	1 853	8,85
Total des Fonds d'investissement		**$ 2 058**	**9,83**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
SAL	4,320 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 2 500	Billets du Trésor américain 0,125 % échéance 15/10/2023	$ (2 549)	$ 2 500	$ 2 501	11,95
SSB	1,900	30/12/2022	03/01/2023	266	Billets du Trésor américain 1,875 % échéance 30/06/2026	(271)	266	266	1,27
Total des Contrats de mise en pension						**$ (2 820)**	**$ 2 766**	**$ 2 767**	**13,22**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2023	4	$ 18	0,09
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ 18**	**0,09**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Boeing Co.	1,000 %	20/06/2023	$ 100	$ 0	0,00

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750 %	15/06/2032	$ 500	$ 15	0,07
À payer	CDI BRL à 1 an	4,100	02/01/2023	BRL 4 500	(64)	(0,31)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	5,100	02/01/2024	400	9	0,04
À recevoir	CDI BRL à 1 an	5,150	02/01/2023	8 000	113	0,54
À payer	CDI BRL à 1 an	5,250	02/01/2023	3 500	(25)	(0,12)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,660	02/01/2025	3 300	(97)	(0,46)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,863	02/01/2023	5 000	(51)	(0,24)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,020	04/01/2027	1 500	55	0,26
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,050	02/01/2025	4 700	94	0,45
À payer	CDI BRL à 1 an	6,140	04/01/2027	7 300	(218)	(1,04)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,250	04/01/2027	700	23	0,11
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,520	04/01/2027	10 200	313	1,50
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,950	04/01/2027	800	27	0,13
À payer	CDI BRL à 1 an	6,960	04/01/2027	6 500	(159)	(0,75)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	7,195	02/01/2023	3 600	29	0,14
À recevoir	CDI BRL à 1 an	7,260	02/01/2023	1 400	11	0,05
À payer	CDI BRL à 1 an	7,310	02/01/2024	1 000	(17)	(0,08)
À payer	CDI BRL à 1 an	7,775	02/01/2024	1 700	(25)	(0,12)
À payer	CDI BRL à 1 an	7,800	04/01/2027	900	(15)	(0,07)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	8,325	04/01/2027	300	7	0,03
À payer	CDI BRL à 1 an	8,355	04/01/2027	400	(9)	(0,04)
À payer	CDI BRL à 1 an	8,450	04/01/2027	300	(7)	(0,03)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	8,675	04/01/2027	1 700	12	0,06
À recevoir	CDI BRL à 1 an	9,600	04/01/2027	2 700	(13)	(0,06)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,206	04/01/2027	100	(1)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	10,240	04/01/2027	500	4	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	10,665	02/01/2024	100	(1)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	10,755	02/01/2024	300	(2)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,833	02/01/2024	500	(3)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,995	02/01/2024	100	(1)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	10,995	04/01/2027	300	(3)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,020	04/01/2027	200	(2)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,045	04/01/2027	300	(2)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,048	04/01/2027	400	(3)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,050	04/01/2027	300	(2)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,055	04/01/2027	300	(2)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,065	02/01/2024	300	(2)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,065	04/01/2027	300	(2)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,130	04/01/2027	200	(2)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,140	04/01/2027	300	(2)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,148	02/01/2024	100	(1)	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,445	02/01/2025	600	2	0,01
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,505	02/01/2024	500	2	0,01
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,515	02/01/2025	900	3	0,02
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,530	02/01/2024	1 900	8	0,04
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,535	02/01/2024	600	3	0,01
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,540	02/01/2024	500	2	0,01
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,543	02/01/2024	500	2	0,01
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,708	02/01/2025	100	0	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,734	02/01/2025	400	(1)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,740	02/01/2025	200	1	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,750	02/01/2025	200	1	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,800	02/01/2025	400	(1)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,835	02/01/2025	400	(1)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,845	02/01/2025	1 100	(3)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,870	02/01/2025	900	(2)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,005	02/01/2025	900	(2)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,105	02/01/2025	1 000	(2)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,290	02/01/2024	600	0	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,425	02/01/2025	1 500	(2)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,740	02/01/2025	600	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,740	02/01/2025	1 500	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,765	02/01/2025	700	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,850	02/01/2025	1 900	(1)	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,190	02/01/2025	300	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,215	02/01/2025	200	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,400	02/01/2025	600	(1)	(0,01)
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	1,860	07/05/2025	CNY 1 700	(1)	(0,01)
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	21/09/2027	2 040	6	0,03

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel		Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	2,630 %	24/07/2024	COP	1 748 000	$ 51	0,24
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	2,650	24/07/2024		2 178 000	63	0,30
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	2,740	24/07/2024		2 486 300	(70)	(0,33)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	2,750	24/07/2024		2 024 100	(30)	(0,14)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	2,995	24/11/2025		113 800	5	0,02
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,080	13/01/2026		922 300	(40)	(0,19)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,125	15/01/2026		386 000	16	0,08
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,680	03/11/2027		449 500	13	0,06
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,975	23/06/2027		216 900	10	0,05
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,040	13/01/2031		1 002 000	65	0,31
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,155	15/01/2031		1 175 400	35	0,17
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,200	18/09/2030		2 296 200	(81)	(0,39)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,410	03/11/2027		2 822 000	131	0,62
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,495	10/10/2024		244 300	(6)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,655	11/05/2026		1 344 458	48	0,23
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,175	28/05/2027		1 045 600	36	0,17
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,630	11/01/2027		1 088 400	28	0,14
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,885	31/01/2025		224 000	4	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,080	02/02/2027		79 000	2	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,130	31/01/2027		81 000	2	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,140	01/02/2027		149 300	3	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,500	15/02/2025		148 000	2	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,585	14/02/2027		236 000	(4)	(0,02)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,855	22/02/2025		286 700	4	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,890	08/04/2027		173 000	3	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,913	08/04/2027		266 200	5	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,940	08/04/2027		134 000	2	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,020	08/04/2025		440 000	6	0,03
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,200	11/03/2027		366 000	(5)	(0,03)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,240	15/03/2027		101 600	(1)	(0,01)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,320	31/03/2027		203 000	(3)	(0,01)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,360	02/06/2027		358 000	(5)	(0,02)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,560	30/03/2027		58 200	(1)	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,686	30/03/2027		346 500	(4)	(0,02)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,890	12/05/2029		269 000	(3)	(0,01)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,050	03/11/2027		3 357 000	(29)	(0,14)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,055	26/08/2026		200 000	2	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,177	26/11/2025		218 700	2	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,270	26/11/2025		243 000	2	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,280	26/11/2025		610 000	5	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,310	26/11/2025		473 000	3	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,430	16/06/2027		130 000	1	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,470	01/07/2025		285 000	2	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,840	03/11/2027		534 700	1	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,920	13/09/2027		752 000	(1)	(0,01)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,950	04/10/2032		131 700	0	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,110	26/11/2025		852 000	2	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,180	03/11/2027		173 800	0	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,420	02/12/2027		203 200	1	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,720	18/11/2025		1 317 100	0	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,800	02/12/2025		234 200	0	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,820	02/12/2025		757 100	1	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,950	19/12/2024		61 500	0	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,640	21/10/2025		817 000	(4)	(0,02)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,930	10/11/2025		435 400	3	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	12,000	26/11/2025		31 000	0	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	12,050	26/11/2025		1 370 000	(10)	(0,05)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	12,060	09/11/2025		308 000	2	0,01
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	1,750	15/12/2026	KRW	1 102 560	(63)	(0,30)
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	1,750	15/12/2031		643 770	67	0,32
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	21/09/2027		242 040	1	0,00
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	5,375	20/10/2026	ZAR	5 900	31	0,15
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	5,601	09/06/2026		900	(4)	(0,02)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	5,680	08/06/2026		2 400	(10)	(0,05)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	6,067	21/12/2026		3 100	11	0,05
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	6,410	11/02/2023		1 500	0	0,00
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	6,635	04/02/2027		5 500	1	0,00
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,205	22/04/2027		1 200	2	0,01
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,210	22/04/2027		900	2	0,01
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	8,180	05/07/2027		2 400	(1)	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	8,500	17/10/2027		10 600	9	0,04
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,290	05/11/2025	CLP	123 100	22	0,11
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,582	02/02/2026		40 000	(8)	(0,04)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,640	12/01/2026		293 300	63	0,30
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,935	10/03/2025		288 700	46	0,22
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,950	05/05/2026		318 600	(55)	(0,26)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,020	30/04/2026		335 000	(58)	(0,28)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,080	01/06/2030		62 000	(15)	(0,07)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,110	01/06/2030		20 000	(5)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,270	15/03/2026		682 000	(120)	(0,57)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,545	05/02/2026		88 000	(14)	(0,07)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,565	27/11/2030		35 000	(8)	(0,04)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,585	27/11/2030		35 000	(8)	(0,04)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,640 %	01/03/2026	CLP 326 000	$ 54	0,26
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,680	12/01/2031	325 000	(83)	(0,40)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,000	14/06/2026	436 000	55	0,26
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,120	05/02/2030	29 000	(5)	(0,03)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,215	14/01/2030	143 000	28	0,14
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,245	15/03/2031	142 400	27	0,13
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,520	14/06/2028	13 800	1	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,900	14/06/2031	224 000	27	0,13
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	4,695	01/03/2025	200 000	18	0,08
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	4,870	15/11/2026	53 000	(2)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,045	14/12/2026	23 300	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,100	15/11/2031	10 000	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,120	15/11/2031	10 000	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,130	01/03/2025	80 000	6	0,03
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,180	01/10/2028	35 000	1	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,240	01/09/2030	60 000	1	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,260	01/03/2026	60 000	3	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,370	01/10/2028	17 900	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,400	01/10/2028	35 000	1	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,420	01/10/2028	76 000	2	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,470	01/09/2030	50 000	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,570	01/10/2028	70 000	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,600	12/12/2027	19 000	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,610	08/02/2027	62 000	(2)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,635	12/12/2027	40 000	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,725	07/02/2025	114 000	7	0,03
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,770	21/11/2027	80 700	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,890	17/03/2032	12 100	(1)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,910	21/01/2027	30 800	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,915	01/02/2025	92 800	5	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,930	17/03/2032	12 100	(1)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,940	01/03/2025	50 000	(2)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,975	11/02/2027	58 000	(1)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,000	11/02/2027	114 000	(2)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,010	16/02/2029	30 000	1	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,020	02/03/2029	2 900	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,030	10/02/2027	50 000	(1)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,055	10/02/2027	28 000	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,110	01/09/2030	23 100	1	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,120	08/03/2027	18 700	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,130	16/02/2027	40 000	(1)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,195	04/03/2027	58 600	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,195	04/04/2028	33 000	1	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,250	01/10/2028	4 600	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,255	08/04/2032	22 000	(2)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,260	08/04/2032	21 000	(2)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,270	02/03/2027	6 100	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,299	08/04/2032	24 000	(2)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,300	11/03/2027	48 000	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,333	05/04/2027	26 000	1	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,350	15/03/2027	21 000	(1)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,350	04/04/2027	27 000	1	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,360	25/05/2027	46 500	1	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,370	29/06/2029	39 000	2	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,380	03/06/2027	116 000	2	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,386	24/05/2027	103 000	2	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,420	24/03/2029	16 000	1	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,500	12/12/2025	29 000	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,550	15/06/2032	16 000	2	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,567	12/12/2025	12 000	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,590	16/06/2032	49 000	5	0,03
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,610	17/06/2032	40 300	5	0,03
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,625	04/04/2025	86 000	2	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,628	04/04/2025	126 000	3	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,670	05/04/2025	83 000	2	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,800	05/07/2027	46 000	1	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,850	01/03/2026	80 000	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,040	10/05/2027	25 600	(2)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,110	15/06/2027	28 000	(2)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,160	16/06/2027	199 000	(11)	(0,05)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,160	22/06/2027	22 500	1	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,160	01/10/2028	11 600	1	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,195	01/10/2028	6 500	1	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,214	21/09/2025	49 000	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,220	20/07/2027	186 100	8	0,04
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,270	15/09/2027	39 700	(2)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,280	21/03/2025	217 000	(2)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,540	13/06/2025	13 200	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,550	13/06/2025	13 300	0	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,610	29/08/2027	31 000	2	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,690	10/05/2025	76 800	1	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,815	04/10/2027	63 700	(6)	(0,03)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	8,230	04/08/2025	312 400	(7)	(0,03)

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel		Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	8,500 %	15/07/2025	CLP	54 100	$ (1)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	8,690	19/07/2025		325 800	(11)	(0,05)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	8,740	29/08/2025		74 000	3	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	9,135	01/03/2025		68 000	2	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	9,270	01/03/2025		51 000	2	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	9,300	01/03/2025		94 800	4	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	9,350	01/03/2025		39 800	(2)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	9,370	01/03/2025		40 400	(2)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	9,820	15/09/2024		57 900	(2)	(0,01)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,575	26/03/2026	CZK	700	(4)	(0,02)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,872	05/08/2026		1 200	(4)	(0,02)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	3,490	18/01/2032		4 100	18	0,08
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	3,530	27/12/2026		1 100	(3)	(0,01)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	3,930	18/01/2027		7 700	(17)	(0,08)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,164	14/03/2027		6 400	9	0,04
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,220	14/03/2027		6 300	8	0,04
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,310	15/03/2027		1 200	1	0,01
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,320	15/03/2027		400	0	0,00
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,490	25/03/2027		2 000	1	0,01
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,560	25/03/2027		2 000	1	0,01
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,700	29/03/2027		1 200	0	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,138	14/11/2027		1 200	0	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,180	14/11/2027		1 100	0	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,220	07/07/2027		2 500	(2)	(0,01)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,340	07/07/2027		2 500	(1)	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,606	28/06/2027		1 300	2	0,01
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	€	500	14	0,07
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	13,600	12/12/2024	HUF	5 100	0	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	0,980	09/06/2030	PLN	300	20	0,10
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	2,950	13/12/2026		1 500	39	0,19
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	4,075	07/03/2027		800	12	0,06
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	4,135	08/02/2027		500	(7)	(0,04)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	4,320	09/03/2027		150	2	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	4,350	09/03/2027		150	2	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	4,885	22/03/2027		200	1	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,175	24/03/2027		600	2	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,285	25/03/2027		300	1	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,290	25/03/2027		300	1	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,340	28/03/2027		100	0	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,470	08/04/2027		600	1	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,550	08/04/2027		400	0	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,575	08/04/2027		400	0	0,00
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,870	22/04/2027		300	3	0,01
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,980	13/04/2027		500	2	0,01
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,985	13/04/2027		500	2	0,01
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,010	13/04/2027		400	2	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,725	27/06/2027		700	(9)	(0,04)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,745	05/07/2027		600	2	0,01
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,755	10/05/2027		600	7	0,03
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,830	19/08/2024		3 000	4	0,02
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,843	28/06/2027		300	4	0,02
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,940	09/06/2027		800	11	0,05
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	7,310	30/06/2027		500	7	0,03
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	7,310	30/06/2027		300	(5)	(0,03)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	7,725	23/06/2027		600	13	0,06
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	4,145	13/02/2023	MXN	49 000	27	0,13
À payer	TIIE MXN à 28 jours	4,290	16/02/2023		10 900	(6)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	4,300	16/02/2023		16 700	(9)	(0,04)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	4,340	12/02/2024		34 000	(125)	(0,59)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	4,540	21/02/2024		3 300	12	0,06
À payer	TIIE MXN à 28 jours	4,680	16/03/2023		19 000	(14)	(0,07)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	4,730	06/02/2026		3 600	(22)	(0,11)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	4,830	22/07/2025		1 400	8	0,04
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	4,840	19/02/2025		2 700	13	0,06
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	4,850	19/02/2025		3 700	18	0,09
À payer	TIIE MXN à 28 jours	4,880	07/11/2025		11 900	(69)	(0,33)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	4,900	22/03/2023		8 300	6	0,03
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	4,920	10/04/2023		5 800	6	0,03
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	4,943	12/02/2026		2 300	14	0,06
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	4,950	12/02/2026		3 500	21	0,10
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,120	29/09/2025		8 200	17	0,08
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,282	29/03/2023		19 600	17	0,08
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,325	09/06/2023		14 300	19	0,09
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,520	21/03/2024		21 000	65	0,31
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,605	26/03/2024		500	(2)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,650	22/03/2024		11 000	(33)	(0,16)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,800	06/04/2026		5 000	(24)	(0,12)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,893	05/06/2025		9 200	38	0,18
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,360	22/03/2023		12 300	21	0,10
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,380	19/08/2026		6 700	(28)	(0,13)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,398	16/07/2026		4 100	17	0,08
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,415	16/07/2026		1 600	7	0,03
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,463	18/05/2040		800	9	0,04

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,670 %	19/06/2026	MXN 400	$ 1	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,720	19/06/2026	300	1	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,845	02/07/2026	900	3	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,070	27/08/2031	2 100	11	0,05
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,100	13/06/2031	3 900	23	0,11
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,110	28/11/2023	8 900	(16)	(0,07)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,165	02/10/2026	700	(2)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,180	02/10/2026	1 600	(5)	(0,02)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,240	16/12/2026	2 800	8	0,04
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,250	05/10/2026	390	(1)	(0,01)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,250	16/12/2026	3 300	10	0,05
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,270	23/11/2023	31 500	(53)	(0,25)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,285	12/10/2026	600	(2)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,418	27/10/2031	1 400	(6)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,450	16/10/2026	300	(1)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,510	04/02/2027	2 900	7	0,03
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,525	26/09/2031	1 100	(4)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,533	07/01/2027	2 000	(5)	(0,02)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,643	18/11/2031	2 300	8	0,04
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,650	29/09/2031	290	(1)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,690	16/10/2031	1 500	(5)	(0,02)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,790	09/02/2024	12 800	22	0,10
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,800	13/11/2031	1 800	5	0,03
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,900	19/02/2032	1 200	(3)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,950	20/02/2032	2 000	(5)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,050	24/02/2032	1 800	(4)	(0,02)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,414	14/12/2027	1 800	2	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,431	24/05/2027	2 900	2	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,465	16/08/2027	400	0	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,515	17/12/2027	100	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,700	05/11/2027	200	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,740	30/08/2027	900	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,743	05/11/2027	900	0	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,750	05/04/2024	3 100	3	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,750	30/08/2027	1 800	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,760	05/11/2027	600	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,773	05/11/2027	900	0	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,975	03/06/2027	7 100	10	0,05
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,045	04/11/2027	300	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,053	04/11/2027	300	0	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,060	18/06/2027	1 400	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,070	04/06/2026	600	0	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,090	08/07/2027	1 000	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,117	04/11/2027	800	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,165	05/11/2026	400	0	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,335	02/08/2023	3 900	2	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,500	03/07/2023	24 100	(10)	(0,05)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,525	22/09/2027	2 000	3	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,580	30/06/2023	10 200	(4)	(0,02)
					$ 417	1,99
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ 417**	**1,99**

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

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

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

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

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

OPTIONS ACHETÉES

OPTIONS DE CHANGE

Contrepartie	Description	Prix d'exercice		Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - EUR contre CZK hors cote	CZK	23,830	01/11/2023	38	$ 4	$ 7	0,03
GLM	Option de vente - EUR contre HUF hors cote	HUF	385,000	01/11/2023	9	1	1	0,01
	Option de vente - EUR contre PLN hors cote	PLN	4,560	01/11/2023	38	4	6	0,03
JPM	Option d'achat - AUD contre USD hors cote	$	0,735	04/05/2023	42	3	4	0,02
	Option de vente - EUR contre HUF hors cote	HUF	385,000	01/11/2023	19	2	3	0,01
MBC	Option de vente - USD contre MXN hors cote	MXN	18,310	04/05/2023	25	2	2	0,01
MYI	Option de vente - USD contre BRL hors cote	BRL	4,450	04/05/2023	25	2	1	0,00
	Option de vente - USD contre ZAR hors cote	ZAR	15,925	04/05/2023	25	3	4	0,02
						$ 21	$ 28	0,13

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE CHANGE

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
MYI	Option d'achat - USD contre MXN hors cote	MXN 20,500	28/02/2023	207	$ (2)	$ (1)	0,00

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BRC	QNB Finance Ltd.	1,000 %	20/06/2023	$ 100	$ 1	$ (1)	$ 0	0,00

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

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

SWAPS SUR DEVISES CROISÉES

Contrepartie	À recevoir	À payer	Date d'échéance	Montant notionnel de la devise reçue	Montant notionnel de la devise livrée	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	Taux variable égal à LIBOR USD à 6 mois plus 0,333 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR ARS à 6 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	30/05/2024	$ 170	ARS 7 557	$ (1)	$ 157	$ 156	0,74
	Taux variable égal à LIBOR USD à 6 mois plus 0,282 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR ARS à 6 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	07/06/2027	60	2 693	0	56	56	0,27
						$ (1)	$ 213	$ 212	1,01

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	4,250 %	21/09/2032	MYR 320	$ (2)	$ 4	$ 2	0,01
GLM	À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,170	25/01/2023	COP 55 400	0	0	0	0,00
	À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,265	14/06/2029	CLP 11 100	0	(2)	(2)	(0,01)
	À recevoir	THBFIX THB à 6 mois	1,000	15/12/2026	THB 19 100	2	24	26	0,13
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	1,500	15/12/2031	4 800	(2)	(10)	(12)	(0,06)
MYC	À payer	THBFIX THB à 6 mois	1,500	15/12/2031	5 940	(2)	(12)	(14)	(0,07)
SCX	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	21/09/2027	11 930	4	(5)	(1)	0,00
						$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00

SWAPS DE VOLATILITÉ

Contrepartie	Volatilité à payer/à recevoir	Entité de référence	Taux d'exercice de volatilité	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	À payer	Volatilité réalisée au cours USD contre JPY à 1 an[1]	12,025 %	20/06/2023	$ 3	$ 0	$ 0	$ 0	0,00

(1) Swap de variance

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	CNH	3 310	$	513	$ 34	$ 0	$ 34	0,16
	01/2023	HUF	47 217		121	0	(5)	(5)	(0,03)
	01/2023	¥	105 700		739	0	(63)	(63)	(0,30)
	01/2023	MYR	6 740		1 519	0	(11)	(11)	(0,05)
	01/2023	$	747	HUF	338 002	151	0	151	0,72
	01/2023		4 872	MYR	21 606	33	0	33	0,16
	01/2023		43	RON	217	4	0	4	0,02
	01/2023	ZAR	1 506	$	85	0	(4)	(4)	(0,02)
	02/2023	$	512	CNH	3 310	0	(32)	(32)	(0,15)
	02/2023		39	EGP	863	0	(6)	(6)	(0,03)
	03/2023		30	MXN	597	0	0	0	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	03/2023	ZAR	1 390	$	79	$ 0	$ (3)	$ (3)	(0,01)
	04/2023	PLN	1 113	€	221	0	(14)	(14)	(0,06)
	05/2023	€	51	CZK	1 282	2	0	2	0,01
BPS	01/2023	HUF	49 306	$	129	0	(3)	(3)	(0,01)
	01/2023	MYR	9 810		2 216	0	(11)	(11)	(0,05)
	01/2023	PLN	132		27	0	(3)	(3)	(0,01)
	01/2023	THB	726		21	0	0	0	0,00
	01/2023	$	7	CLP	5 715	0	0	0	0,00
	01/2023		506	CNH	3 310	0	(27)	(27)	(0,13)
	01/2023		35	CZK	888	4	0	4	0,02
	01/2023		15	€	14	0	0	0	0,00
	01/2023		279	ILS	955	0	(8)	(8)	(0,04)
	01/2023		2 216	MYR	9 810	27	0	27	0,13
	01/2023		2	THB	83	0	0	0	0,00
	01/2023		31	TRY	608	1	0	1	0,01
	02/2023	ILS	2 090	$	621	28	0	28	0,13
	02/2023	$	80	IDR	1 255 396	1	0	1	0,01
	03/2023	CLP	464 134	$	481	0	(58)	(58)	(0,28)
	03/2023	COP	7 711 093		1 568	4	(6)	(2)	(0,01)
	03/2023	MXN	10 559		524	0	(10)	(10)	(0,05)
	03/2023	MYR	10 776		2 393	0	(81)	(81)	(0,39)
	03/2023	PEN	1 286		331	0	(4)	(4)	(0,02)
	03/2023	$	309	COP	1 505 822	1	(3)	(2)	(0,01)
	03/2023		1 665	INR	138 155	0	(4)	(4)	(0,02)
	03/2023		152	MXN	2 991	0	(1)	(1)	(0,01)
	03/2023		40	TWD	1 201	0	0	0	0,00
	04/2023	CLP	5 801	$	7	0	0	0	0,00
	05/2023	€	18	CZK	469	1	0	1	0,01
BRC	01/2023	CZK	1 245	$	53	0	(2)	(2)	(0,01)
	01/2023	MYR	99		22	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	RON	108		22	0	(1)	(1)	(0,01)
	01/2023	RSD	5 965		54	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	28	CNH	197	0	0	0	0,00
	01/2023		228	MYR	1 074	17	0	17	0,08
	01/2023		400	PHP	22 330	2	0	2	0,01
	01/2023		4	PLN	18	0	0	0	0,00
	01/2023		1 597	SGD	2 150	7	0	7	0,03
BSH	01/2023	CLP	5 693	$	6	0	0	0	0,00
	08/2023	PEN	61		15	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	CLP	755 059		849	0	(37)	(37)	(0,18)
	01/2023	€	245		260	0	(1)	(1)	(0,01)
	01/2023	HUF	44 497		112	0	(7)	(7)	(0,03)
	01/2023	PEN	1 707		431	0	(15)	(15)	(0,07)
	01/2023	PLN	89		19	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	640	BRL	3 362	0	(4)	(4)	(0,02)
	01/2023		792	CLP	754 804	93	0	93	0,45
	01/2023		565	€	533	4	0	4	0,02
	01/2023		46	KRW	59 692	1	0	1	0,01
	01/2023		11	PLN	52	1	0	1	0,00
	02/2023	BRL	512	$	95	0	(2)	(2)	(0,01)
	02/2023	EGP	858		32	0	0	0	0,00
	02/2023	$	849	CLP	759 218	37	0	37	0,18
	02/2023		54	PEN	219	3	0	3	0,01
	03/2023	COP	400 363	$	84	3	0	3	0,01
	03/2023	ILS	310		91	3	0	3	0,01
	03/2023	PEN	350		87	0	(4)	(4)	(0,02)
	03/2023	TWD	3 136		103	0	0	0	0,00
	03/2023	$	57	COP	276 794	0	0	0	0,00
	03/2023		1 760	MXN	34 550	1	(12)	(11)	(0,05)
	03/2023		61	PEN	236	0	0	0	0,00
	05/2023	ILS	1 586	$	469	16	0	16	0,08
	05/2023	PEN	221		56	0	(1)	(1)	(0,01)
	05/2023	$	0	MXN	8	0	0	0	0,00
	05/2023		166	PEN	659	5	0	5	0,02
	11/2023	ILS	492	$	149	7	0	7	0,03
	11/2023	$	86	EGP	2 763	8	0	8	0,04
CLY	01/2023	HUF	626	$	2	0	0	0	0,00
	01/2023	MYR	334		71	0	(5)	(5)	(0,02)
	03/2023	TWD	689		23	0	0	0	0,00
	11/2023	€	21	HUF	9 727	1	0	1	0,01
DUB	01/2023	DKK	1 463	$	206	0	(4)	(4)	(0,02)
	01/2023	RON	109		22	0	(2)	(2)	(0,01)
	01/2023	$	200	TRY	4 093	17	0	17	0,08
	02/2023	ZAR	798	$	48	1	0	1	0,01
	03/2023	MXN	338		17	0	0	0	0,00
	07/2023	ILS	392		112	0	(1)	(1)	0,00
	11/2023	EGP	1 590		56	2	0	2	0,01
GLM	01/2023	BRL	3 513		659	0	(6)	(6)	(0,03)
	01/2023	COP	1 147 009		237	0	0	0	0,00
	01/2023	HUF	13 305		35	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	MYR	3 581		792	0	(28)	(28)	(0,13)
	01/2023	PLN	179		36	0	(5)	(5)	(0,02)
	01/2023	$	28	BRL	152	1	0	1	0,00

Tableau des investissements Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	01/2023	$	2	CNH	17	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023		237	COP	1 147 009	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		3	HKD	21	0	0	0	0,00
	01/2023		26	HUF	10 050	1	0	1	0,00
	01/2023		328	MYR	1 557	28	0	28	0,13
	01/2023		1 257	PLN	6 367	193	0	193	0,92
	01/2023		1 094	THB	38 129	9	0	9	0,04
	02/2023	COP	254 008	$	50	0	(2)	(2)	(0,01)
	02/2023	DOP	11 356		206	5	0	5	0,02
	02/2023	MXN	740		36	0	(2)	(2)	(0,01)
	02/2023	$	423	COP	1 925 393	0	(29)	(29)	(0,14)
	02/2023		224	DOP	12 359	0	(6)	(6)	(0,03)
	02/2023		2	EGP	51	0	0	0	0,00
	03/2023	CLP	22 952	$	25	0	(2)	(2)	(0,01)
	03/2023	COP	4 749 966		984	18	0	18	0,08
	03/2023	MXN	8 102		398	0	(12)	(12)	(0,06)
	03/2023	$	33	CLP	30 339	2	0	2	0,01
	03/2023		1 242	COP	6 006 246	0	(20)	(20)	(0,10)
	04/2023	DOP	3 668	$	67	3	0	3	0,01
	04/2023	$	648	BRL	3 513	6	0	6	0,03
	05/2023		515	PEN	2 048	17	0	17	0,08
	05/2023	ZAR	1 402	$	84	2	0	2	0,01
	11/2023	EGP	1 593		56	2	0	2	0,01
	11/2023	$	12	EGP	365	0	0	0	0,00
IND	06/2024		82	TWD	2 110	0	(9)	(9)	(0,05)
JPM	01/2023	HUF	129 046	$	327	0	(16)	(16)	(0,08)
	01/2023	TRY	481		25	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	674	CNY	4 691	5	0	5	0,03
	01/2023		67	IDR	1 056 511	1	0	1	0,01
	01/2023		86	TRY	1 636	1	0	1	0,00
	02/2023	EGP	51	$	2	0	0	0	0,00
	02/2023	$	138	IDR	2 168 368	3	0	3	0,01
	02/2023		1 012	MXN	20 747	43	0	43	0,21
	02/2023		66	TWD	2 013	0	(1)	(1)	0,00
	03/2023	IDR	1 057 651	$	67	0	(1)	(1)	(0,01)
	03/2023	MXN	461		23	0	0	0	0,00
	03/2023	$	1 210	CNY	8 374	7	0	7	0,03
	03/2023		128	IDR	2 007 483	2	0	2	0,01
	06/2023		29	VND	696 000	0	0	0	0,00
	11/2023	HUF	9 736	€	21	0	(1)	(1)	(0,01)
MBC	01/2023	DKK	1 323	$	187	0	(3)	(3)	(0,01)
	01/2023	€	764		801	0	(14)	(14)	(0,07)
	01/2023	£	180		219	3	0	3	0,01
	01/2023	¥	2 800		21	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	46	€	44	1	0	1	0,00
	01/2023		76	£	62	0	(1)	(1)	(0,01)
	01/2023		11	HKD	88	0	0	0	0,00
	01/2023		22	¥	2 900	0	0	0	0,00
	02/2023	EGP	863	$	33	0	0	0	0,00
	02/2023	MXN	2 130		104	0	(5)	(5)	(0,02)
	02/2023	$	36	EGP	1 023	3	0	3	0,01
	02/2023		56	MXN	1 126	2	0	2	0,01
	03/2023	MXN	649	$	32	0	(1)	(1)	0,00
	03/2023	$	266	COP	1 213 362	0	(19)	(19)	(0,09)
	03/2023		78	IDR	1 218 423	1	0	1	0,00
	05/2023		74	CNH	499	0	(2)	(2)	(0,01)
MYI	01/2023	CZK	780	$	32	0	(3)	(3)	(0,01)
	01/2023	€	11		11	0	0	0	0,00
	01/2023	£	150		185	4	0	4	0,02
	01/2023	HUF	19 405		47	0	(4)	(4)	(0,02)
	01/2023	IDR	1 049 240		68	0	0	0	0,00
	01/2023	KRW	64 456		50	0	(1)	(1)	(0,01)
	01/2023	MYR	478		103	0	(7)	(7)	(0,03)
	01/2023	PLN	221		47	0	(3)	(3)	(0,02)
	01/2023	$	211	£	172	0	(4)	(4)	(0,02)
	01/2023		393	MYR	1 861	33	0	33	0,16
	01/2023		5	PLN	25	1	0	1	0,00
	01/2023		122	ZAR	2 221	9	0	9	0,04
	02/2023	EGP	165	$	6	0	0	0	0,00
	02/2023	IDR	18 862		1	0	0	0	0,00
	02/2023	$	122	TWD	3 722	0	0	0	0,00
	02/2023		320	ZAR	5 854	23	0	23	0,11
	02/2023	ZAR	5 411	$	297	0	(20)	(20)	(0,09)
	03/2023	$	109	IDR	1 716 755	2	0	2	0,01
	03/2023		14	ZAR	256	1	0	1	0,00
	04/2023	ZAR	2 001	$	108	0	(9)	(9)	(0,04)
	05/2023	CZK	185	€	7	0	(1)	(1)	0,00
RBC	01/2023	PLN	25	$	5	0	0	0	0,00
	01/2023	$	34	HUF	14 446	4	0	4	0,02
	03/2023	MXN	4 099	$	205	0	(3)	(3)	(0,01)
RYL	01/2023	SGD	32		24	0	0	0	0,00
	01/2023	$	7	HUF	2 684	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	CLP	551	$	1	0	0	0	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	01/2023	MYR	5 056	$	1 142	$ 0	$ (6)	$ (6)	(0,03)
	01/2023	PEN	111		28	0	(1)	(1)	(0,01)
	01/2023	$	2 136	KRW	2 823 052	108	0	108	0,51
	01/2023		1 142	MYR	5 056	14	0	14	0,07
	02/2023		145	IDR	2 281 598	3	0	3	0,01
	02/2023		1 144	TWD	35 212	7	0	7	0,03
	03/2023	INR	349	$	4	0	0	0	0,00
	03/2023	MXN	486		24	0	0	0	0,00
	03/2023	$	106	IDR	1 657 385	1	0	1	0,00
	04/2023	KES	1 600	$	12	0	(1)	(1)	0,00
SOG	01/2023	$	433	RON	2 199	41	0	41	0,20
	01/2023	ZAR	715	$	40	0	(2)	(2)	(0,01)
	03/2023	KES	1 166		9	0	0	0	0,00
	05/2023	CZK	312	€	12	0	(1)	(1)	0,00
TOR	01/2023	¥	350 000	$	2 443	0	(213)	(213)	(1,02)
	02/2023	$	11	ZAR	188	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	CZK	534	$	21	0	(2)	(2)	(0,01)
	01/2023	HUF	69 510		175	0	(11)	(11)	(0,05)
	01/2023	RON	227		46	0	(3)	(3)	(0,01)
	01/2023	TRY	430		21	0	(1)	(1)	(0,01)
	01/2023	$	612	CZK	15 559	75	0	75	0,36
	01/2023		102	£	82	0	(3)	(3)	(0,01)
	01/2023		451	TRY	9 018	27	0	27	0,13
	02/2023	CNH	3 310	$	515	35	0	35	0,17
	02/2023	$	213	IDR	3 386 245	6	0	6	0,03
	03/2023		26	MXN	524	0	0	0	0,00
	03/2023	ZAR	2 840	$	159	0	(7)	(7)	(0,03)
	05/2023	CNH	499		72	0	(1)	(1)	0,00
	05/2023	€	31	CZK	773	1	0	1	0,01
						$ 1 274	$ (954)	$ 320	1,53
Total des Instruments financiers dérivés hors cote								**$ 558**	**2,67**

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CERTIFICATS DE DÉPÔT				
Bancolombia S.A.				
2,860 % éch. 25/02/2024	COP	50 000	$ 10	0,05
8,711 % éch. 04/04/2023		165 100	34	0,16
12,021 % éch. 04/08/2023		120 000	24	0,11
14,763 % éch. 12/05/2023		50 200	10	0,05
Total des Certificats de dépôt			**$ 78**	**0,37**
Total des Investissements			**$ 21 159**	**101,06**
Autres actifs et passifs à court terme			**$ (222)**	**(1,06)**
Actif net			**$ 20 937**	**100,00**

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

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

^ **Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.**

(a) Titre à rémunération en nature.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

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

(f) Affilié au Fonds.

(g) Titre convertible conditionnel.

(h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,85 %) :

Description de l'émetteur	Coupon		Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Banque de développement d'Afrique du Sud	8,600	%	21/10/2024	07/10/2021	$ 215	$ 185	0,88
Flourish Century	6,600		04/02/2049	25/08/2021	197	22	0,11
					$ 412	$ 207	0,99

Un montant en numéraire de 282 $ (31 décembre 2021 : 302 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 15 014	$ 250	$ 15 264
Fonds d'investissement	205	1 853	0	2 058
Contrats de mise en pension	0	2 766	0	2 766
Instruments financiers dérivés[3]	0	993	0	993
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	34	44	78
Totaux	**$ 205**	**$ 20 660**	**$ 294**	**$ 21 159**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 25 257	$ 318	$ 25 575
Fonds d'investissement	2 833	0	0	2 833
Contrats de mise en pension	0	193	0	193
Instruments financiers dérivés[3]	0	520	0	520
Totaux	**$ 2 833**	**$ 25 970**	**$ 318**	**$ 29 121**

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

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

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ 95	$ 0	$ 95	$ (83)	$ 0	$ (83)
BPS	(152)	0	(152)	84	0	84
BRC	21	0	21	(23)	0	(23)
BSS	S/O	S/O	S/O	10	0	10
CBK	98	0	98	(122)	0	(122)
CLY	(4)	0	(4)	S/O	S/O	S/O
DUB	13	0	13	30	0	30
GLM	404	(270)	134	228	(10)	218
HUS	S/O	S/O	S/O	138	0	138
IND	(9)	0	(9)	128	0	128
JPM	49	0	49	32	0	32
MBC	(34)	0	(34)	S/O	S/O	S/O
MYC	(14)	0	(14)	1	0	1
MYI	25	0	25	26	0	26
RBC	1	0	1	(2)	0	(2)
RYL	S/O	S/O	S/O	2	0	2
SCX	124	0	124	S/O	S/O	S/O
SOG	38	0	38	S/O	S/O	S/O
SSB	S/O	S/O	S/O	(128)	0	(128)
TOR	(213)	0	(213)	36	0	36
UAG	116	0	116	48	0	48

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	27,93	58,69
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	44,26	25,70
Autres valeurs mobilières	0,70	1,54
Fonds d'investissement	9,83	9,52
Contrats de mise en pension	13,22	0,65
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,09	S/O
Instruments financiers dérivés compensés	1,99	0,39
Instruments financiers dérivés hors cote	2,67	1,36
Certificats de dépôt	0,37	S/O

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Argentine	0,22	0,21
Azerbaïdjan	0,93	S/O
Brésil	2,81	2,69
Îles Caïmans	0,21	2,19
Chili	0,03	3,05
Chine	0,11	S/O
Colombie	1,99	4,90
République tchèque	0,85	S/O
Danemark	1,89	1,86
République dominicaine	0,31	S/O
Égypte	S/O	0,67
France	S/O	0,11
Hongrie	0,93	0,38
Inde	S/O	1,35
Indonésie	0,00	S/O
Irlande	1,52	2,62
Israël	2,07	11,76
Italie	S/O	0,38
Jersey, Îles Anglo-Normandes	0,51	S/O
Luxembourg	0,13	0,70
Malaisie	S/O	0,65
Île Maurice	0,87	0,72
Mexique	1,62	0,86
Pays-Bas	0,05	0,07
Nigeria	S/O	0,17
Pérou	1,60	1,30
Pologne	0,37	S/O
Qatar	0,45	0,39
Serbie	S/O	0,20
Singapour	S/O	0,68
Afrique du Sud	3,99	4,85
Espagne	S/O	0,78
Ukraine	S/O	0,79
Royaume-Uni	1,48	S/O
États-Unis	5,71	6,37
Zambie	0,13	0,92
Instruments à court terme	42,11	34,31
Fonds d'investissement	9,83	9,52
Contrats de mise en pension	13,22	0,65
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,09	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	S/O	0,01
Swaps de taux d'intérêt	1,99	0,38
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Options de change	0,13	0,08
Options vendues		
Options de change	0,00	(0,01)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	(0,01)
Swaps sur devises croisées	1,01	0,62
Swaps de taux d'intérêt	0,00	(0,01)
Swaps de volatilité	0,00	0,00
Contrats de change à terme	1,53	0,69
Certificats de dépôt	0,37	S/O
Autres actifs et passifs à court terme	(1,06)	2,15
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO ESG Income Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
TerraForm Power Operating LLC				
7,430 % éch. 21/05/2029	$	498	$ 495	0,21
Wm Morrison Supermarkets PLC				
6,552 % éch. 04/11/2027	€	518	487	0,20
6,552 % éch. 31/07/2028		282	266	0,11
			1 248	0,52
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				
ABN AMRO Bank NV				
2,470 % éch. 13/12/2029	$	400	324	0,14
Acef Holding S.C.A.				
0,750 % éch. 14/06/2028	€	100	79	0,03
1,250 % éch. 26/04/2030		300	221	0,09
AIB Group PLC				
2,875 % éch. 30/05/2031		400	384	0,16
Ally Financial, Inc.				
2,200 % éch. 02/11/2028	$	600	469	0,20
8,000 % éch. 01/11/2031		350	362	0,15
American Express Co.				
4,050 % éch. 03/05/2029		500	477	0,20
American Tower Corp.				
3,100 % éch. 15/06/2050		200	127	0,05
3,800 % éch. 15/08/2029		150	136	0,06
Banque de développement asiatique				
6,550 % éch. 26/01/2025	ZAR	42 000	2 406	1,01
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
5,875 % éch. 24/09/2023 (e)(f)	€	400	411	0,17
Banco BTG Pactual S.A.				
2,750 % éch. 11/01/2026	$	600	546	0,23
Banco de Sabadell S.A.				
0,875 % éch. 16/06/2028	€	100	86	0,04
Banco do Brasil S.A.				
4,875 % éch. 11/01/2029	$	400	373	0,16
Banco Mercantil del Norte S.A.				
6,625 % éch. 24/01/2032 (e)(f)		200	166	0,07
Bancolombia S.A.				
3,000 % éch. 29/01/2025		600	569	0,24
Bank Mandiri Persero Tbk PT				
2,000 % éch. 19/04/2026		200	179	0,07
Bank of America Corp.				
2,687 % éch. 22/04/2032		200	161	0,07
6,204 % éch. 10/11/2028		300	310	0,13
Banque Ouest Africaine de Développement				
2,750 % éch. 22/01/2033	€	470	381	0,16
Barclays PLC				
4,836 % éch. 09/05/2028	$	400	370	0,16
5,501 % éch. 09/08/2028		500	485	0,20
7,250 % éch. 15/03/2023 (e)(f)	£	200	238	0,10
7,750 % éch. 15/09/2023 (e)(f)	$	200	196	0,08
BNP Paribas S.A.				
1,675 % éch. 30/06/2027		400	349	0,15
2,871 % éch. 19/04/2032		200	157	0,07
4,625 % éch. 25/02/2031 (e)(f)		200	155	0,06
7,750 % éch. 16/08/2029 (e)(f)		800	792	0,33
Boston Properties LP				
2,550 % éch. 01/04/2032		400	305	0,13
BPCE S.A.				
2,045 % éch. 19/10/2027		300	259	0,11
Brookfield Finance UK PLC				
2,340 % éch. 30/01/2032		550	420	0,18
CaixaBank S.A.				
3,625 % éch. 14/09/2028 (e)(f)	€	200	151	0,06
3,750 % éch. 07/09/2029		300	314	0,13
Castellum Helsinki Finance Holding Abp				
0,875 % éch. 17/09/2029		300	209	0,09
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund				
0,900 % éch. 12/10/2029		500	390	0,16
Citigroup, Inc.				
2,976 % éch. 05/11/2030	$	200	169	0,07
4,615 % éch. 25/01/2026 (h)		500	489	0,21
Citycon Treasury BV				
1,625 % éch. 12/03/2028	€	300	234	0,10
CNP Assurances				
1,250 % éch. 27/01/2029	€	400	$ 345	0,14
Cooperatieve Rabobank UA				
1,004 % éch. 24/09/2026	$	900	796	0,33
Corporate Office Properties LP				
2,000 % éch. 15/01/2029		100	77	0,03
CPI Property Group S.A.				
1,750 % éch. 14/01/2030	€	300	195	0,08
2,750 % éch. 22/01/2028	£	300	242	0,10
Credit Agricole Assurances S.A.				
1,500 % éch. 06/10/2031	€	200	157	0,07
Crown Castle, Inc.				
3,100 % éch. 15/11/2029	$	550	481	0,20
CTP NV				
1,250 % éch. 21/06/2029	€	400	285	0,12
1,500 % éch. 27/09/2031		400	257	0,11
Deutsche Bank AG				
3,035 % éch. 28/05/2032 (h)	$	350	266	0,11
3,742 % éch. 07/01/2033		500	356	0,15
Digital Dutch Finco BV				
0,625 % éch. 15/07/2025	€	600	574	0,24
1,000 % éch. 15/01/2032		500	375	0,16
EQT AB				
0,875 % éch. 14/05/2031		600	445	0,19
2,375 % éch. 06/04/2028		700	658	0,28
Equinix, Inc.				
2,500 % éch. 15/05/2031	$	50	40	0,02
3,900 % éch. 15/04/2032		260	232	0,10
First American Financial Corp.				
2,400 % éch. 15/08/2031		600	440	0,18
Ford Motor Credit Co. LLC				
4,687 % éch. 09/06/2025		200	191	0,08
5,584 % éch. 18/03/2024		200	198	0,08
FS KKR Capital Corp.				
3,125 % éch. 12/10/2028		450	364	0,15
Globalworth Real Estate Investments Ltd.				
2,950 % éch. 29/07/2026	€	400	340	0,14
Goldman Sachs Group, Inc.				
2,383 % éch. 21/07/2032	$	800	623	0,26
Goodman U.S. Finance Five LLC				
4,625 % éch. 04/05/2032		700	640	0,27
GPT Wholesale Office Fund				
3,222 % éch. 05/11/2031	AUD	400	211	0,09
Grainger PLC				
3,000 % éch. 03/07/2030	£	100	90	0,04
Growthpoint Properties International Pty. Ltd.				
5,872 % éch. 02/05/2023	$	200	199	0,08
Hanwha Life Insurance Co. Ltd.				
3,379 % éch. 04/02/2032		300	249	0,10
HAT Holdings LLC				
3,375 % éch. 15/06/2026		610	531	0,22
3,750 % éch. 15/09/2030		230	169	0,07
Host Hotels & Resorts LP				
2,900 % éch. 15/12/2031		100	77	0,03
3,375 % éch. 15/12/2029		800	670	0,28
3,500 % éch. 15/09/2030		240	199	0,08
Howard Hughes Corp.				
4,375 % éch. 01/02/2031		700	567	0,24
HSBC Holdings PLC				
3,973 % éch. 22/05/2030		200	175	0,07
Hudson Pacific Properties LP				
3,950 % éch. 01/11/2027		250	213	0,09
5,950 % éch. 15/02/2028		150	140	0,06
Indian Railway Finance Corp. Ltd.				
3,570 % éch. 21/01/2032		950	817	0,34
ING Groep NV				
4,125 % éch. 24/08/2033	€	300	302	0,13
4,250 % éch. 16/05/2031 (e)(f)	$	200	138	0,06
4,875 % éch. 16/05/2029 (e)(f)		700	542	0,23
Banque internationale pour la reconstruction et le développement				
3,000 % éch. 27/09/2023		10 950	10 798	4,55
Intesa Sanpaolo SpA				
4,198 % éch. 01/06/2032		200	147	0,06
5,017 % éch. 26/06/2024		200	192	0,08
6,250 % éch. 16/05/2024 (e)(f)	€	200	206	0,09
Kilroy Realty LP				
2,500 % éch. 15/11/2032	$	640	$ 456	0,19
2,650 % éch. 15/11/2033		200	139	0,06
Kookmin Bank				
2,500 % éch. 04/11/2030 (f)		200	160	0,07
Lendlease Finance Ltd.				
3,400 % éch. 27/10/2027	AUD	1 100	651	0,27
Logicor Financing SARL				
2,000 % éch. 17/01/2034	€	500	340	0,14
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
2,494 % éch. 13/10/2032	$	400	313	0,13
Mizuho Financial Group, Inc.				
2,201 % éch. 10/07/2031		200	157	0,07
MPT Operating Partnership LP				
3,375 % éch. 24/04/2030	£	200	158	0,07
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen				
5,875 % éch. 23/05/2042	$	400	400	0,17
Nationstar Mortgage Holdings, Inc.				
5,750 % éch. 15/11/2031		300	234	0,10
NE Property BV				
2,000 % éch. 20/01/2030	€	200	148	0,06
3,375 % éch. 14/07/2027		300	278	0,12
New Immo Holding S.A.				
2,750 % éch. 26/11/2026		200	182	0,08
Nexi SpA				
1,625 % éch. 30/04/2026		259	253	0,11
Nomura Holdings, Inc.				
2,172 % éch. 14/07/2028	$	600	496	0,21
OneMain Finance Corp.				
3,500 % éch. 15/01/2027		826	685	0,29
Owl Rock Capital Corp.				
2,875 % éch. 11/06/2028		200	157	0,07
PennyMac Financial Services, Inc.				
5,750 % éch. 15/09/2031		200	159	0,07
Radian Group, Inc.				
6,625 % éch. 15/03/2025		400	395	0,17
Rexford Industrial Realty LP				
2,150 % éch. 01/09/2031		100	77	0,03
Santander Holdings USA, Inc.				
5,807 % éch. 09/09/2026		800	795	0,33
Santander UK Group Holdings PLC				
3,823 % éch. 03/11/2028		200	179	0,07
Segro Capital SARL				
1,875 % éch. 23/03/2030	€	250	228	0,10
Sirius Real Estate Ltd.				
1,125 % éch. 22/06/2026		400	334	0,14
1,750 % éch. 24/11/2028		200	147	0,06
SLM Corp.				
3,125 % éch. 02/11/2026	$	900	767	0,32
Société Générale S.A.				
4,750 % éch. 26/05/2026 (e)(f)		200	170	0,07
Sofina S.A.				
1,000 % éch. 23/09/2028	€	200	167	0,07
Standard Chartered PLC				
2,678 % éch. 29/06/2032	$	500	378	0,16
3,603 % éch. 12/01/2033 (h)		200	151	0,06
7,750 % éch. 02/04/2023 (e)(f)		400	398	0,17
Starwood Property Trust, Inc.				
3,625 % éch. 15/07/2026		680	596	0,25
4,375 % éch. 15/01/2027		310	272	0,11
SVB Financial Group				
4,570 % éch. 29/04/2033		370	328	0,14
Svenska Handelsbanken AB				
4,750 % éch. 01/03/2031 (e)(f)		200	164	0,07
UBS Group AG				
4,375 % éch. 10/02/2031 (e)(f)		200	152	0,06
UniCredit SpA				
5,459 % éch. 30/06/2035		300	244	0,10
VIA Outlets BV				
1,750 % éch. 15/11/2028	€	500	404	0,17
Vonovia SE				
1,875 % éch. 28/06/2028		200	182	0,08
2,375 % éch. 25/03/2032		200	170	0,07
Weyerhaeuser Co.				
7,375 % éch. 15/03/2032	$	85	94	0,04

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Workspace Group PLC				
2,250 % éch. 11/03/2028	£	500	$ 449	0,19
ZF Finance GmbH				
2,000 % éch. 06/05/2027	€	400	351	0,15
2,250 % éch. 03/05/2028		100	84	0,04
			52 100	21,90
INDUSTRIE				
AA Bond Co. Ltd.				
4,875 % éch. 31/07/2043	£	500	570	0,24
Accor S.A.				
2,375 % éch. 29/11/2028	€	900	824	0,35
Allegion U.S. Holding Co., Inc.				
3,550 % éch. 01/10/2027	$	200	181	0,08
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC				
3,000 % éch. 01/09/2029	€	600	471	0,20
Ball Corp.				
3,125 % éch. 15/09/2031	$	580	467	0,20
BCP Modular Services Finance PLC				
4,750 % éch. 30/11/2028	€	100	90	0,04
Boise Cascade Co.				
4,875 % éch. 01/07/2030	$	380	333	0,14
CDW LLC				
3,569 % éch. 01/12/2031		500	413	0,17
Cellnex Finance Co. S.A.				
3,875 % éch. 07/07/2041		200	137	0,06
Coty, Inc.				
3,875 % éch. 15/04/2026	€	300	299	0,13
DaVita, Inc.				
3,750 % éch. 15/02/2031	$	400	299	0,13
Fair Isaac Corp.				
4,000 % éch. 15/06/2028		610	555	0,23
Faurecia SE				
2,750 % éch. 15/02/2027	€	500	452	0,19
Flex Ltd.				
6,000 % éch. 15/01/2028	$	300	300	0,13
Ford Motor Co.				
3,250 % éch. 12/02/2032		80	60	0,03
Fortune Brands Innovations, Inc.				
3,250 % éch. 15/09/2029		150	130	0,05
Gap, Inc.				
3,625 % éch. 01/10/2029		200	141	0,06
3,875 % éch. 01/10/2031		300	210	0,09
GN Store Nord A/S				
0,875 % éch. 25/11/2024	€	400	385	0,16
Graphic Packaging International LLC				
2,625 % éch. 01/02/2029		400	375	0,16
HCA, Inc.				
4,500 % éch. 15/02/2027	$	500	483	0,20
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
3,625 % éch. 15/02/2032		380	305	0,13
4,000 % éch. 01/05/2031		200	168	0,07
InterContinental Hotels Group PLC				
3,375 % éch. 08/10/2028	£	500	521	0,22
JCDecaux SE				
1,625 % éch. 07/02/2030	€	300	256	0,11
JDE Peet's NV				
2,250 % éch. 24/09/2031	$	600	455	0,19
John Lewis PLC				
6,125 % éch. 21/01/2025	£	200	231	0,10
Lendlease Europe Finance PLC				
3,500 % éch. 02/12/2033		400	309	0,13
Lenovo Group Ltd.				
3,421 % éch. 02/11/2030	$	400	318	0,13
Level 3 Financing, Inc.				
3,750 % éch. 15/07/2029		80	58	0,02
Liberty Utilities Finance GP				
2,050 % éch. 15/09/2030		300	226	0,09
Lindblad Expeditions LLC				
6,750 % éch. 15/02/2027		300	273	0,11
Marks & Spencer PLC				
3,750 % éch. 19/05/2026	£	100	105	0,04
4,500 % éch. 10/07/2027		350	363	0,15
Metalsa S.A. de C.V.				
3,750 % éch. 04/05/2031	$	150	118	0,05
MSCI, Inc.				
3,625 % éch. 01/09/2030	$	400	$ 333	0,14
Natura Cosmeticos S.A.				
4,125 % éch. 03/05/2028		600	490	0,21
Nemak S.A.B. de C.V.				
2,250 % éch. 20/07/2028	€	400	341	0,14
Newell Brands, Inc.				
4,875 % éch. 01/06/2025	$	200	195	0,08
NextEra Energy Operating Partners LP				
3,875 % éch. 15/10/2026		180	165	0,07
Nokia Oyj				
3,125 % éch. 15/05/2028	€	400	405	0,17
NXP BV				
2,500 % éch. 11/05/2031	$	250	200	0,08
5,000 % éch. 15/01/2033		1 000	947	0,40
Owens Corning				
3,950 % éch. 15/08/2029		300	273	0,11
Pearson Funding PLC				
3,750 % éch. 04/06/2030	£	100	107	0,04
Prosus NV				
3,061 % éch. 13/07/2031	$	600	464	0,20
3,257 % éch. 19/01/2027		300	269	0,11
RELX Capital, Inc.				
4,750 % éch. 20/05/2032		800	771	0,32
ReNew Power Pvt Ltd.				
5,875 % éch. 05/03/2027		200	192	0,08
Rexel S.A.				
2,125 % éch. 15/12/2028	€	300	279	0,12
S&P Global, Inc.				
2,700 % éch. 01/03/2029	$	700	618	0,26
Schaeffler AG				
3,375 % éch. 12/10/2028	€	200	186	0,08
Sixt SE				
1,750 % éch. 09/12/2024		200	206	0,09
Standard Industries, Inc.				
2,250 % éch. 21/11/2026		600	550	0,23
Tesco Corporate Treasury Services PLC				
0,375 % éch. 27/07/2029		300	248	0,10
Transurban Finance Co. Pty. Ltd.				
2,450 % éch. 16/03/2031	$	500	394	0,17
Travis Perkins PLC				
3,750 % éch. 17/02/2026	£	400	427	0,18
Verallia S.A.				
1,625 % éch. 14/05/2028	€	500	461	0,19
1,875 % éch. 10/11/2031		500	418	0,18
VeriSign, Inc.				
2,700 % éch. 15/06/2031	$	650	531	0,22
Vilmorin & Cie S.A.				
1,375 % éch. 26/03/2028	€	300	237	0,10
Vmed O2 UK Financing PLC				
4,500 % éch. 15/07/2031	£	200	185	0,08
4,750 % éch. 15/07/2031	$	600	489	0,21
Wabtec Transportation Netherlands BV				
1,250 % éch. 03/12/2027	€	400	363	0,15
Weir Group PLC				
2,200 % éch. 13/05/2026	$	400	355	0,15
Zenith Finco PLC				
6,500 % éch. 30/06/2027	£	200	189	0,08
			22 169	9,32
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
AES Corp.				
2,450 % éch. 15/01/2031	$	300	239	0,10
Atlantica Sustainable Infrastructure PLC				
4,125 % éch. 15/06/2028		200	178	0,07
Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.				
4,250 % éch. 25/03/2027		191	166	0,07
Clearway Energy Operating LLC				
3,750 % éch. 15/02/2031		630	524	0,22
Enel Finance America LLC				
7,100 % éch. 14/10/2027		800	829	0,35
Enel Finance International NV				
1,375 % éch. 12/07/2026		300	259	0,11
2,250 % éch. 12/07/2031		400	292	0,12
Greenko Dutch BV				
3,850 % éch. 29/03/2026	$	191	$ 166	0,07
Greenko Power Ltd.				
4,300 % éch. 13/12/2028		191	161	0,07
Greenko Solar Mauritius Ltd.				
5,950 % éch. 29/07/2026		200	183	0,08
Iberdrola International BV				
6,750 % éch. 15/09/2033		250	264	0,11
India Green Energy Holdings				
5,375 % éch. 29/04/2024		250	241	0,10
India Green Power Holdings				
4,000 % éch. 22/02/2027		250	214	0,09
Leeward Renewable Energy Operations LLC				
4,250 % éch. 01/07/2029		500	428	0,18
National Grid PLC				
0,250 % éch. 01/09/2028	€	400	347	0,15
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
1,900 % éch. 15/06/2028	$	400	342	0,14
2,200 % éch. 02/12/2026	AUD	400	242	0,10
Pattern Energy Operations LP				
4,500 % éch. 15/08/2028	$	500	449	0,19
Southern California Edison Co.				
2,500 % éch. 01/06/2031		400	331	0,14
3,650 % éch. 01/06/2051		200	146	0,06
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.				
6,750 % éch. 24/04/2033		324	307	0,13
TDC Net A/S				
5,056 % éch. 31/05/2028	€	300	315	0,13
TerraForm Power Operating LLC				
5,000 % éch. 31/01/2028	$	230	207	0,09
TransAlta Corp.				
7,750 % éch. 15/11/2029		400	409	0,17
Verizon Communications, Inc.				
2,850 % éch. 03/09/2041		300	208	0,09
Vodafone Group PLC				
5,125 % éch. 04/06/2081		113	83	0,03
			7 530	3,16
Total des Obligations et billets privés			81 799	34,38
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Fannie Mae				
3,500 % éch. 01/08/2059		3 355	3 082	1,30
4,000 % éch. 01/11/2059		147	140	0,06
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)				
3,000 % éch. 01/07/2052		497	437	0,18
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				
2,000 % éch. 01/01/2053		500	407	0,17
2,500 % éch. 01/01/2053		1 750	1 482	0,62
4,000 % éch. 01/01/2053		19 300	18 109	7,61
4,500 % éch. 01/02/2053		5 600	5 391	2,27
5,000 % éch. 01/01/2053		23 500	23 158	9,73
5,500 % éch. 01/02/2053		9 100	9 121	3,83
6,000 % éch. 01/01/2053		7 700	7 812	3,28
			69 139	29,05
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d)				
0,125 % éch. 15/07/2024		50	49	0,02
0,125 % éch. 15/10/2024		139	134	0,06
0,125 % éch. 15/07/2031		1 379	1 219	0,51
0,125 % éch. 15/01/2032		6 665	5 842	2,46
0,625 % éch. 15/01/2024		243	238	0,10
0,750 % éch. 15/02/2045		202	164	0,07
1,000 % éch. 15/02/2046		516	438	0,18
1,375 % éch. 15/02/2044		805	749	0,31
Billets du Trésor américain				
2,375 % éch. 31/03/2029		2 100	1 910	0,81
3,875 % éch. 30/09/2029		2 400	2 383	1,00
			13 126	5,52
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
1211 Avenue of the Americas Trust				
4,142 % éch. 10/08/2035		1 895	1 606	0,68
225 Liberty Street Trust				
4,501 % éch. 10/02/2036		1 200	1 058	0,44

Tableau des investissements Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
280 Park Avenue Mortgage Trust				
5,317 % éch. 15/09/2034	$	2 297	$ 2 185	0,92
Banc of America Funding Trust				
6,479 % éch. 25/10/2036 þ		65	58	0,02
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust				
0,597 % éch. 10/08/2033 (a)		9 200	131	0,06
4,216 % éch. 10/08/2033		105	96	0,04
4,498 % éch. 10/08/2035		1 600	1 481	0,62
4,563 % éch. 10/08/2033		2 190	1 886	0,79
4,957 % éch. 10/08/2035		350	297	0,13
Bear Stearns ALT-A Trust				
4,709 % éch. 25/06/2046 ^		810	675	0,28
Commercial Mortgage Trust				
3,832 % éch. 10/02/2036		3 000	2 683	1,13
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				
4,479 % éch. 19/03/2037		1 349	1 086	0,46
EMF-UK PLC				
4,491 % éch. 13/03/2046	£	3 566	4 198	1,76
European Loan Conduit DAC				
4,175 % éch. 22/07/2029		897	1 050	0,44
Independence Plaza Trust				
3,763 % éch. 10/07/2035	$	345	324	0,14
3,911 % éch. 10/07/2035		1 940	1 814	0,76
4,158 % éch. 10/07/2035		132	122	0,05
4,356 % éch. 10/07/2035		1 050	956	0,40
Madison Avenue Mortgage Trust				
3,366 % éch. 15/08/2034		690	635	0,27
3,484 % éch. 15/08/2034		225	203	0,09
3,976 % éch. 15/08/2034		1 900	1 703	0,72
MortgageIT Trust				
4,989 % éch. 25/08/2035		398	372	0,16
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust				
3,790 % éch. 15/11/2032		1 220	1 072	0,45
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
4,769 % éch. 25/12/2036		78	66	0,03
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				
3,726 % éch. 25/04/2037		44	34	0,01
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
5,034 % éch. 25/04/2035		52	50	0,02
Towd Point Mortgage Funding PLC				
3,596 % éch. 20/10/2051	£	3 000	3 524	1,48
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,329 % éch. 25/11/2036 ^		93	79	0,03
Worldwide Plaza Trust				
3,596 % éch. 10/11/2036	$	1 795	$ 1 248	0,52
			30 692	12,90

TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS

Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
5,439 % éch. 25/05/2035	1 275	1 141	0,48
Argent Securities Trust			
4,689 % éch. 25/06/2036	2 034	615	0,26
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
4,889 % éch. 25/08/2036	1 287	1 165	0,49
5,514 % éch. 25/02/2035	63	63	0,03
BNC Mortgage Loan Trust			
3,797 % éch. 25/10/2036	106	78	0,03
Centex Home Equity Loan Trust			
5,304 % éch. 25/10/2035	72	72	0,03
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
4,529 % éch. 25/06/2047 ^	72	64	0,03
4,909 % éch. 25/12/2036 ^	329	305	0,13
First Franklin Mortgage Loan Trust			
4,129 % éch. 25/03/2036	1 446	1 272	0,53
5,139 % éch. 25/12/2035	1 026	970	0,41
GSAMP Trust			
4,869 % éch. 25/06/2036	1 888	1 013	0,42
5,289 % éch. 25/11/2035 ^	100	93	0,04
Lehman XS Trust			
4,709 % éch. 25/02/2037	639	610	0,26
Long Beach Mortgage Loan Trust			
4,539 % éch. 25/11/2036	527	371	0,15
4,699 % éch. 25/08/2036	2 614	1 414	0,59
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
5,064 % éch. 25/09/2035	500	468	0,20
Mosaic Solar Loans LLC			
4,450 % éch. 20/06/2042	529	507	0,21
Soundview Home Loan Trust			
4,889 % éch. 25/10/2036	626	593	0,25
Structured Asset Investment Loan Trust			
5,364 % éch. 25/05/2035	1 405	1 186	0,50
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
4,679 % éch. 25/07/2036 ^	1 314	1 261	0,53
Structured Asset Securities Corp. Trust			
6,693 % éch. 25/05/2031	78	63	0,03
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
5,389 % éch. 25/10/2034	$ 1 051	$ 1 018	0,43
		14 342	6,03

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Obligation internationale du gouvernement chilien				
2,750 % éch. 31/01/2027		300	276	0,11
3,500 % éch. 31/01/2034		300	256	0,11
Fondo MIVIVIENDA S.A.				
4,625 % éch. 12/04/2027		300	285	0,12
Banque de développement coréenne				
4,800 % éch. 10/06/2023	IDR	1 150 000	73	0,03
Obligation internationale du gouvernement mexicain				
2,250 % éch. 12/08/2036	€	870	661	0,28
Obligation internationale du gouvernement roumain				
1,750 % éch. 13/07/2030		600	448	0,19
Obligation internationale du gouvernement serbe				
1,000 % éch. 23/09/2028		400	308	0,13
Obligation internationale du gouvernement sud-africain				
10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	8 500	528	0,22
			2 835	1,19

INSTRUMENTS À COURT TERME

BILLETS À COURT TERME

Federal Home Loan Bank				
4,320 % éch. 06/01/2023	$	1 700	1 700	0,72
4,320 % éch. 10/01/2023		1 600	1 600	0,67
			3 300	1,39

BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN

4,050 % éch. 26/01/2023(b)(c)	3 000	2 993	1,26
4,386 % éch. 30/03/2023 (b)(c)	35 000	34 634	14,55
		37 627	15,81
Total des Instruments à court terme		40 927	17,20
Total des Valeurs mobilières		**$ 254 108**	**106,79**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BPS	4,150 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 44 400	Billets du Trésor américain 1,625 % échéance 15/05/2031	$ (45 259)	$ 44 400	$ 44 420	18,66
Total des Contrats de mise en pension						**$ (45 259)**	**$ 44 400**	**$ 44 420**	**18,66**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2024	5	$ 23	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2025	3	8	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2026	4	10	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2024	4	13	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2025	2	5	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2024	4	16	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2025	2	5	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2026	3	8	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2024	3	9	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2025	3	8	0,00
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	2	2	0,00

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	2	$ (11)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	47	(2)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Court	03/2023	119	37	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	14	(4)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	10	6	0,00
				$ 133	0,05

(1) Option de style contrat à terme standardisé.

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Nbre de Contrats	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	$ 98,000	15/12/2023	3	$ (2)	$ (0)	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	3	(3)	(9)	0,00
				$ (5)	$ (9)	0,00
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					**$ 124**	**0,05**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
British Telecommunications PLC	1,000 %	20/06/2028	€ 200	$ (6)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2028	900	(27)	(0,01)
Tesco PLC	1,000	20/06/2028	100	(3)	0,00
				$ (36)	(0,01)

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000 %	15/03/2033	£ 1 500	$ (36)	(0,01)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2026	¥ 330 000	40	0,02
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	16/06/2028	890 000	222	0,09
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2028	1 690 000	129	0,06
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	15/06/2032	330 000	99	0,04
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,500	15/03/2042	170 000	110	0,05
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,573	28/02/2027	$ 300	(26)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,600	16/01/2026	2 700	64	0,03
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,618	09/02/2029	200	(22)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,620	18/04/2027	300	(26)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,650	08/02/2032	250	(36)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,730	24/02/2032	150	(21)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,765	16/03/2032	300	(41)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,770	14/02/2032	150	(20)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,783	22/04/2027	400	(32)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,788	03/05/2027	500	(41)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,817	05/04/2032	150	(20)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,872	06/04/2032	150	(19)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,888	22/03/2029	200	(19)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,928	25/03/2027	300	(22)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2027	14 620	126	0,05
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2029	1 870	8	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2032	5 090	(110)	(0,05)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,250	17/06/2027	400	(25)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,300	17/01/2026	2 000	47	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,350	17/01/2025	3 500	51	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,370	21/06/2027	400	(23)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,430	30/09/2027	460	28	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,450	20/12/2024	6 800	102	0,04
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,450	04/10/2027	460	28	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,605	28/06/2027	400	(18)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,850	30/08/2027	1 000	(36)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,880	30/09/2027	1 300	(43)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,900	04/10/2027	1 300	(42)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,955	04/10/2027	300	(9)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,050	07/09/2027	600	(16)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029	600	(18)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,050	06/09/2032	500	(17)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,100	09/09/2029	600	(16)	(0,01)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,350 %	14/12/2032	$ 100	$ 2	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,610	12/12/2032	200	0	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,750	13/12/2027	400	1	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,500	16/06/2028	150	18	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,750	16/06/2031	100	16	0,01
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,250	15/12/2026	6 000	(684)	(0,29)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	16/06/2051	40	9	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,270	04/11/2023	8 800	(278)	(0,12)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,350	20/01/2027	200	21	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,360	15/02/2027	550	58	0,03
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,380	04/01/2027	500	(51)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,418	20/01/2027	250	(25)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,420	24/02/2027	400	41	0,02
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,425	18/01/2027	500	(50)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,443	18/01/2027	500	(49)	(0,02)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,450	17/02/2027	500	50	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,450	16/07/2031	50	9	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	15/12/2028	800	(114)	(0,05)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	12/01/2029	110	14	0,01
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,518	20/01/2029	150	(19)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,535	15/10/2031	200	(35)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,550	20/01/2027	700	(65)	(0,03)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,570	11/01/2027	200	(19)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,570	12/01/2027	100	(9)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,580	16/02/2027	300	(28)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,600	15/02/2027	2 200	(201)	(0,08)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	26/01/2029	150	(18)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,650	24/02/2027	1 300	(116)	(0,05)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,655	24/01/2032	150	(25)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,700	06/03/2024	500	(16)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,700	17/02/2027	2 100	(182)	(0,08)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,700	12/01/2029	400	(47)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,735	12/01/2032	150	(24)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,785	12/08/2051	50	16	0,01
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,815	24/01/2052	50	(15)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,867	26/01/2052	50	(15)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,000	18/02/2032	200	(27)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,000	15/12/2051	200	(65)	(0,03)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	€ 700	(62)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	400	(35)	(0,01)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028	4 000	187	0,08
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053	300	11	0,01
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	6 900	75	0,03
					$ (1 446)	(0,61)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ (1 482)**	**(0,62)**

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

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

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

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

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,110 %	26/07/2032	200	$ 32	$ 26	0,01
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,110	26/07/2032	300	49	62	0,02
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,053	20/07/2023	2 600	16	1	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,053	20/07/2023	2 600	16	39	0,02
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,620	22/07/2024	2 600	19	9	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,620	22/07/2024	2 600	20	29	0,01
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,400	20/07/2027	200	26	19	0,01
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,400	20/07/2027	200	26	36	0,01
							$ 204	$ 221	0,08

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150 %	01/12/2023	400	$ (1)	$ 0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	01/12/2023	400	(1)	(3)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	19/01/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,500	19/01/2023	200	(1)	(3)	0,00
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	11/04/2023	100	0	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	11/04/2023	100	0	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	28/04/2023	400	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	28/04/2023	400	(1)	(6)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,150	09/01/2023	400	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	09/01/2023	400	(1)	(3)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	23/01/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,770	23/01/2023	200	(1)	(1)	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	19/01/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,500	19/01/2023	200	(1)	(3)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	12/01/2023	300	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	12/01/2023	300	(1)	(1)	0,00
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,690	02/04/2024	100	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,690	02/04/2024	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,150	09/01/2023	400	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	09/01/2023	400	(1)	(3)	0,00
DUB	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	300	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	300	(2)	(4)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,790	08/04/2024	200	(2)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,790	08/04/2024	200	(2)	(2)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,765	25/07/2023	1 100	(7)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,765	25/07/2023	1 100	(7)	(20)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,468	25/07/2023	200	(5)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,468	25/07/2023	200	(5)	(10)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	200	(1)	(3)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	200	(1)	(3)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	200	(1)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	200	(1)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	200	(1)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	200	(1)	(3)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	200	(1)	(3)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	200	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,088	03/11/2023	200	(2)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,910	10/11/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,910	10/11/2023	200	(1)	(3)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	400	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	400	(2)	(3)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	400	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/11/2023	400	(1)	(3)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	400	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	400	(1)	(3)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,697	02/04/2024	500	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,697	02/04/2024	500	(4)	(6)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,721	08/04/2024	200	(2)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,721	08/04/2024	200	(2)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	05/04/2023	400	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	05/04/2023	400	(1)	(6)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	11/04/2023	700	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	11/04/2023	700	(1)	(11)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	26/04/2023	400	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	26/04/2023	400	(1)	(6)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	15/05/2023	500	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	15/05/2023	500	(1)	(8)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547	07/03/2023	400	(9)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	400	(9)	(25)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	600	(7)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	600	(8)	(20)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,230	23/01/2023	600	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,730	23/01/2023	600	(2)	(4)	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	12/01/2023	300	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	12/01/2023	300	(1)	(1)	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,052	20/07/2023	1 100	(7)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,052	20/07/2023	1 100	(7)	(17)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,675	20/07/2023	200	(5)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,675	20/07/2023	200	(5)	(9)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,993	11/10/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,993	11/10/2023	200	(1)	(3)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,537	20/07/2023	100	(7)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,537	20/07/2023	100	(7)	(14)	(0,01)
							$ (177)	$ (237)	(0,10)

OPTIONS À TAUX D'INTÉRÊT PLAFONNÉES

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
MYC	Option d'achat - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote[2]	LIBOR USD à 1 an	0,030 %	24/07/2024	2 600	$ (19)	$ (41)	(0,02)
	Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote[2]	LIBOR USD à 1 an	0,030	24/07/2024	2 600	(19)	(4)	0,00
	Option d'achat - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote[2]	LIBOR USD à 1 an	0,026	23/07/2025	2 600	(23)	(32)	(0,01)
	Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote[2]	LIBOR USD à 1 an	0,026	23/07/2025	2 600	(23)	(12)	(0,01)
						$ (84)	$ (89)	(0,04)

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

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	$ 101,891	05/01/2023	300	$ (1)	$ 0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	100,000	06/02/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	102,000	06/02/2023	100	(1)	0	0,00
JPM	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	97,000	06/03/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	97,156	06/03/2023	100	(1)	(2)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	99,000	06/03/2023	100	(1)	0	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	99,156	06/03/2023	100	(1)	0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	98,766	06/03/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	100,766	06/03/2023	100	(1)	0	0,00
SAL	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	97,578	06/03/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	99,578	06/03/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	102,250	05/01/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	99,750	06/02/2023	300	0	(2)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	100,000	06/02/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	101,750	06/02/2023	300	0	(1)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	102,000	06/02/2023	100	(1)	0	0,00
					$ (14)	$ (11)	0,00

[1] Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
MYC	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000 %	20/12/2026	$ 1 000	$ (44)	$ 5	$ (39)	(0,02)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
MYC	Indice CMBX.NA.AAA.14 Index	0,500 %	16/12/2072	$ 1 600	$ (39)	$ 12	$ (27)	(0,01)

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

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

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	02/2023	£ 4 353	$ 5 145	$ 5	$ (102)	$ (97)	(0,04)
	02/2023	$ 297	€ 278	1	0	1	0,00
	02/2023	177	¥ 24 800	12	0	12	0,01
	02/2023	338	NOK 3 358	3	0	3	0,00
	02/2023	109	ZAR 1 948	5	0	5	0,00
	03/2023	309	MXN 6 148	2	0	2	0,00
BPS	01/2023	381	ZAR 6 626	8	0	8	0,00
	02/2023	€ 17 461	$ 18 106	0	(584)	(584)	(0,24)
	03/2023	$ 806	MXN 16 250	16	0	16	0,01
BRC	02/2023	513	NOK 5 120	8	0	8	0,00
CBK	01/2023	CLP 209 791	$ 236	0	(10)	(10)	0,00
	01/2023	$ 10	BRL 51	0	0	0	0,00
	01/2023	220	CLP 209 721	26	0	26	0,01
	02/2023	£ 6 424	$ 7 816	81	0	81	0,03
	02/2023	$ 1 349	AUD 2 015	20	0	20	0,01
	02/2023	236	CLP 210 947	10	0	10	0,01
	02/2023	186	€ 174	0	0	0	0,00
	02/2023	1 013	NZD 1 583	0	(11)	(11)	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	03/2023	IDR	1 278 167	$	82	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	03/2023	$	247	MXN	4 844	0	(2)	(2)	0,00
	05/2023	MXN	51	$	3	0	0	0	0,00
DUB	02/2023	$	85	ZAR	1 415	0	(2)	(2)	0,00
GLM	01/2023	BRL	51	$	10	0	0	0	0,00
	01/2023	$	2 031	KRW	2 646 888	73	0	73	0,03
	01/2023		111	ZAR	1 990	5	0	5	0,00
	02/2023		10	BRL	51	0	0	0	0,00
	03/2023	MXN	1 658	$	81	0	(3)	(3)	0,00
	05/2023	$	149	ZAR	2 486	0	(4)	(4)	0,00
JPM	01/2023		181	KRW	237 396	7	0	7	0,00
	02/2023	€	1 881	$	2 006	0	(7)	(7)	0,00
	02/2023	$	3 277	¥	451 566	166	0	166	0,07
	02/2023		613	MXN	12 568	26	0	26	0,01
MBC	02/2023		367	AUD	546	4	0	4	0,00
	02/2023		1 692	CAD	2 242	0	(38)	(38)	(0,01)
	02/2023		337	¥	45 600	10	0	10	0,00
	03/2023		141	MXN	2 834	3	0	3	0,00
MYI	01/2023	€	58	$	62	0	0	0	0,00
	01/2023	$	145	ZAR	2 529	4	0	4	0,00
	02/2023	€	116	$	121	0	(3)	(3)	0,00
	02/2023	$	1 585	AUD	2 338	3	0	3	0,00
	02/2023		234	¥	31 800	8	0	8	0,00
	02/2023		232	ZAR	4 127	10	0	10	0,00
UAG	03/2023		272	MXN	5 404	2	0	2	0,00
						$ 518	$ (767)	$ (249)	(0,10)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en AUD (couverte) de distribution et R en AUD (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	AUD	141	$	95	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	01/2023	$	14 840	AUD	22 018	95	0	95	0,04
CBK	01/2023	AUD	752	$	510	0	0	0	0,00
	01/2023	$	968	AUD	1 430	5	(3)	2	0,00
MBC	01/2023		7 339		10 915	70	(5)	65	0,03
MYI	01/2023		17 618		26 235	178	0	178	0,08
UAG	01/2023		19 718		29 212	97	0	97	0,04
						$ 445	$ (9)	$ 436	0,19

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	254	CHF	240	$ 6	$ 0	$ 6	(0,01)
CBK	01/2023		440		416	9	0	9	0,00
MBC	01/2023		305		282	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	CHF	5	$	5	0	0	0	0,00
	01/2023	$	2 294	CHF	2 132	12	0	12	0,01
RYL	01/2023		2 294		2 132	12	0	12	0,01
SCX	01/2023		2 294		2 132	12	0	12	0,01
						$ 51	$ 0	$ 51	0,02

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, E en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$	1 749	€	1 642	$ 4	$ 0	$ 4	0,00
BOA	01/2023		1 971		1 869	24	0	24	0,01
BPS	01/2023	€	314	$	335	0	(1)	(1)	0,00
BRC	01/2023	$	11 053	€	10 404	55	0	55	0,02
CBK	01/2023	€	354	$	375	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	$	32 885	€	31 630	887	0	887	0,38
MBC	01/2023	€	4	$	4	0	0	0	0,00
	01/2023	$	33 880	€	32 305	613	0	613	0,26
RYL	01/2023		6 973		6 602	76	0	76	0,03
SCX	01/2023		30 111		28 929	777	0	777	0,33
						$ 2 436	$ (4)	$ 2 432	1,03

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 4	$ 5	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$ 165	£ 137	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	£ 1	$ 1	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	$ 172	£ 143	1	0	1	0,00
MYI	01/2023	4	3	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	151	126	0	0	0	0,00
				$ 1	$ 0	$ 1	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	SEK 8	$ 1	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$ 273	SEK 2 819	0	(2)	(2)	0,00
CBK	01/2023	SEK 1 232	$ 120	1	0	1	0,00
	01/2023	$ 3 789	SEK 39 632	18	(2)	16	0,01
MBC	01/2023	66	686	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	5 192	54 607	51	0	51	0,02
SCX	01/2023	1 132	11 898	10	0	10	0,00
UAG	01/2023	8 909	93 471	65	0	65	0,03
				$ 145	$ (4)	$ 141	0,06

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 84	SGD 115	$ 2	$ 0	$ 2	0,00
BPS	01/2023	84	115	2	0	2	0,00
GLM	01/2023	14	19	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	88	121	2	0	2	0,00
UAG	01/2023	SGD 3	$ 2	0	0	0	0,00
				$ 6	$ 0	$ 6	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ 2 636**	**1,11**

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
3,000 % éch. 01/02/2053	$ 500	$ (439)	(0,19)
3,500 % éch. 01/01/2053	400	(364)	(0,15)
6,000 % éch. 01/01/2053 (g)	1 800	(1 827)	(0,77)
Total des Titres vendus à découvert		**$ (2 630)**	**(1,11)**
Total des Investissements		**$ 297 156**	**124,88**
Autres actifs et passifs à court terme		**$ (59 195)**	**(24,88)**
Actif net		**$ 237 961**	**100,00**

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

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

(f) Titre convertible conditionnel.

(g) Les titres vendus à découvert au 31 décembre 2022 sont couverts par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.

(h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,28 %) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Citigroup, Inc.	4,615 %	25/01/2026	19/07/2022	$ 485	$ 489	0,21
Deutsche Bank AG	3,035	28/05/2032	25/08/2021 - 02/09/2021	359	266	0,11
Standard Chartered PLC	3,603	12/01/2033	05/01/2022	200	151	0,06
				$ 1 044	$ 906	0,38

Un montant en numéraire de 1 927 $ (31 décembre 2021 : 2 030 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un titre d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 102 $) et un montant en numéraire de 810 $ (31 décembre 2021 : 0 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 254 108	$ 0	$ 254 108
Contrats de mise en pension	0	44 400	0	44 400
Instruments financiers dérivés[3]	(9)	1 287	0	1 278
Titres vendus à découvert	0	(2 630)	0	(2 630)
Totaux	**$ (9)**	**$ 297 165**	**$ 0**	**$ 297 156**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 122 326	$ 0	$ 122 326
Instruments financiers dérivés	0	1 270	0	1 270
Titres vendus à découvert	0	(204)	0	(204)
Totaux	**$ 0**	**$ 123 392**	**$ 0**	**$ 123 392**

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

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

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ 4	$ 0	$ 4	$ S/O	$ S/O	$ S/O
BOA	43	0	43	34	0	34
BPS	(571)	550	(21)	310	0	310
BRC	59	0	59	229	(140)	89
CBK	1 021	(950)	71	(9)	0	(9)
DUB	(9)	0	(9)	S/O	S/O	S/O
GLM	3	260	263	(11)	0	(11)
HUS	S/O	S/O	S/O	310	(330)	(20)
JPM	187	0	187	S/O	S/O	S/O
MBC	660	(350)	310	S/O	S/O	S/O
MYC	(69)	0	(69)	3	0	3
MYI	263	(20)	243	65	102	167
RYL	88	0	88	S/O	S/O	S/O
SAL	(6)	0	(6)	(11)	0	(11)
SCX	799	(780)	19	279	0	279
SSB	S/O	S/O	S/O	8	0	8
UAG	164	0	164	(46)	0	(46)

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	36,58	42,95
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	69,50	52,99
Autres valeurs mobilières	0,71	1,85
Contrats de mise en pension	18,66	S/O
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,05	(0,06)
Instruments financiers dérivés compensés	(0,62)	0,14
Instruments financiers dérivés hors cote	1,11	0,93
Titres vendus à découvert	(1,11)	(0,16)

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Crédits consortiaux et cessions	0,52	S/O
Obligations et billets privés	34,38	50,66
Agences du gouvernement américain	29,05	4,26
Obligations du Trésor américain	5,52	2,72
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	12,90	11,55
Titres adossés à des actifs	6,03	4,24
Émissions souveraines	1,19	2,39
Instruments à court terme	17,20	21,97
Contrats de mise en pension	18,66	S/O
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,05	(0,06)
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	0,00	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,01)	(0,03)
Swaps de taux d'intérêt	(0,61)	0,17
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,08	S/O
Options vendues		
Options de change	S/O	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,10)	(0,03)
Options à taux d'intérêt plafonnées	(0,04)	S/O
Options sur titres	0,00	(0,01)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,02)	S/O
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	(0,01)	S/O
Swaps de taux d'intérêt	S/O	0,01
Contrats de change à terme	(0,10)	0,10
Contrats de change à terme couverts	1,30	0,86
Titres vendus à découvert	(1,11)	(0,16)
Autres actifs et passifs à court terme	(24,88)	1,36
Actif net	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
6,173 % éch. 22/06/2026	$	214	€ 200	0,01
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				
AMCO - Asset Management Co. SpA				
1,500 % éch. 17/07/2023	€	9 000	8 915	0,47
Banca Carige SpA				
0,625 % éch. 28/10/2029		6 600	5 609	0,29
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
5,875 % éch. 24/09/2023 (e)(g)		1 200	1 156	0,06
Banco Santander S.A.				
4,375 % éch. 14/01/2026 (e)(g)		5 200	4 434	0,23
Bank of America Corp.				
2,243 % éch. 25/04/2024		900	900	0,05
Barclays PLC				
2,885 % éch. 31/01/2027		4 000	3 793	0,20
3,125 % éch. 17/01/2024	£	8 700	9 588	0,50
4,375 % éch. 15/03/2028 (e)(g)	$	200	143	0,01
7,750 % éch. 15/09/2023 (e)(g)		700	642	0,03
BNP Paribas S.A.				
4,500 % éch. 25/02/2030 (e)(g)		200	144	0,01
CaixaBank S.A.				
3,625 % éch. 14/09/2028 (e)(g)	€	200	141	0,01
6,750 % éch. 13/06/2024 (e)(g)		2 000	1 956	0,10
Citigroup, Inc.				
4,412 % éch. 31/03/2031	$	8 100	6 987	0,36
Cooperatieve Rabobank UA				
3,250 % éch. 29/12/2026 (e)(g)	€	1 400	1 197	0,06
4,625 % éch. 29/12/2025 (e)(g)		3 800	3 523	0,18
CPI Property Group S.A.				
1,500 % éch. 27/01/2031		6 500	3 773	0,20
1,625 % éch. 23/04/2027		700	500	0,03
2,750 % éch. 12/05/2026		8 000	6 301	0,33
2,750 % éch. 22/01/2028	£	4 500	3 397	0,18
Credit Suisse AG				
1,000 % éch. 07/06/2023	€	1 300	1 280	0,07
3,184 % éch. 31/05/2024		6 800	6 591	0,34
6,500 % éch. 08/08/2023 (g)	$	2 600	2 365	0,12
Credit Suisse Group AG				
3,250 % éch. 02/04/2026	€	6 000	5 398	0,28
4,194 % éch. 01/04/2031	$	2 500	1 823	0,09
7,250 % éch. 12/09/2025 (e)(g)		7 300	4 918	0,26
7,500 % éch. 17/07/2023 (e)(g)		2 200	1 652	0,09
Credit Suisse Schweiz AG				
3,390 % éch. 05/12/2025	€	7 700	7 593	0,40
CTP NV				
0,500 % éch. 21/06/2025		3 200	2 687	0,14
Deutsche Bank AG				
1,375 % éch. 03/09/2026		7 400	6 751	0,35
1,625 % éch. 20/01/2027		3 000	2 650	0,14
2,222 % éch. 18/09/2024	$	1 900	1 720	0,09
4,000 % éch. 29/11/2027	€	3 000	2 967	0,15
4,500 % éch. 30/11/2026 (e)(g)		200	157	0,01
Dexia Credit Local S.A.				
0,000 % éch. 21/01/2028 (b)		4 300	3 654	0,19
0,010 % éch. 22/01/2027		6 700	5 890	0,31
0,500 % éch. 17/01/2025		3 500	3 309	0,17
DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH				
2,500 % éch. 25/01/2027		6 500	4 873	0,25
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial				
0,010 % éch. 23/06/2028		10 500	8 814	0,46
Banque européenne d'investissement				
0,250 % éch. 20/01/2032		4 200	3 271	0,17
European Union				
0,000 % éch. 06/07/2026 (b)		1 100	992	0,05
0,000 % éch. 04/07/2029 (b)		1 000	825	0,04
0,000 % éch. 04/07/2031 (b)		4 200	3 251	0,17
0,250 % éch. 22/04/2036		23 000	15 740	0,82
0,450 % éch. 04/07/2041		8 600	5 227	0,27
0,450 % éch. 02/05/2046		930	517	0,03
0,700 % éch. 06/07/2051		1 000	546	0,03
0,750 % éch. 04/01/2047		7 700	4 616	0,24
1,625 % éch. 04/12/2029	€	3 000	€ 2 736	0,14
Fab Sukuk Co. Ltd.				
3,625 % éch. 05/03/2023	$	1 500	1 402	0,07
Fédération des Caisses Desjardins du Québec				
2,875 % éch. 28/11/2024	€	3 400	3 363	0,18
Ford Motor Credit Co. LLC				
1,744 % éch. 19/07/2024		3 500	3 351	0,17
2,748 % éch. 14/06/2024	£	6 500	6 943	0,36
General Motors Financial Co., Inc.				
1,000 % éch. 24/02/2025	€	3 400	3 177	0,17
Goldman Sachs Group, Inc.				
2,605 % éch. 30/04/2024		14 100	14 103	0,74
2,732 % éch. 07/02/2025		7 300	7 284	0,38
5,702 % éch. 15/03/2024	$	1 700	1 592	0,08
HSBC Holdings PLC				
6,250 % éch. 23/03/2023 (e)(g)		2 400	2 197	0,11
6,500 % éch. 20/05/2024	£	1 800	2 060	0,11
ING Groep NV				
3,875 % éch. 16/05/2027 (e)(g)	$	200	137	0,01
4,875 % éch. 16/05/2029 (e)(g)		8 200	5 955	0,31
Intesa Sanpaolo SpA				
5,500 % éch. 01/03/2028 (e)(g)	€	250	207	0,01
JAB Holdings BV				
2,000 % éch. 18/05/2028		5 100	4 564	0,24
Jyske Realkredit A/S				
0,375 % éch. 01/07/2024		800	766	0,04
1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	15	1	0,00
1,500 % éch. 01/10/2037		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		23	2	0,00
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				
0,000 % éch. 15/09/2028 (b)	€	6 500	5 465	0,29
0,000 % éch. 15/06/2029 (b)		11 100	9 132	0,48
0,000 % éch. 15/09/2031 (b)		17 900	13 694	0,72
2,000 % éch. 15/11/2029		17 100	15 987	0,84
5,000 % éch. 19/03/2024	AUD	200	129	0,01
Landesbank Baden-Wuerttemberg				
2,000 % éch. 24/02/2025	$	3 300	2 905	0,15
LeasePlan Corp. NV				
1,000 % éch. 02/05/2023	€	1 100	1 093	0,06
1,375 % éch. 07/03/2024		6 100	5 927	0,31
Liberty Mutual Group, Inc.				
3,625 % éch. 23/05/2059		10 700	9 469	0,49
Lloyds Bank PLC				
4,875 % éch. 30/03/2027	£	4 000	4 515	0,24
Metropolitan Life Global Funding				
0,900 % éch. 08/06/2023	$	3 400	3 133	0,16
Nexi SpA				
1,625 % éch. 30/04/2026	€	3 797	3 470	0,18
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	58 456	5 470	0,29
1,000 % éch. 01/10/2053		12 669	1 164	0,06
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2050		8 287	908	0,05
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % éch. 27/01/2025	€	5 200	4 717	0,25
Nova Ljubljanska Banka dd				
10,750 % éch. 28/11/2032		5 700	5 785	0,30
Nykredit Realkredit A/S				
0,500 % éch. 01/10/2043	DKK	8 892	913	0,05
1,000 % éch. 01/10/2050		393 131	36 877	1,93
1,000 % éch. 01/10/2053		24	2	0,00
1,500 % éch. 01/10/2037		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2047		4	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		80 031	7 902	0,41
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2050		57 440	6 291	0,33
2,000 % éch. 01/10/2053		5 665	606	0,03
2,500 % éch. 01/10/2036		363	46	0,00
2,500 % éch. 01/10/2047		28	3	0,00
3,000 % éch. 01/10/2053		4 655	556	0,03
3,500 % éch. 01/10/2053	DKK	38 735	€ 4 788	0,25
5,000 % éch. 01/10/2053		24 130	3 166	0,17
Realkredit Danmark A/S				
1,500 % éch. 01/10/2047		66	7	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		96 205	9 418	0,49
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2050		14 939	1 636	0,09
2,500 % éch. 01/04/2036		1	0	0,00
Royal Bank of Canada				
4,784 % éch. 12/12/2025	$	6 500	6 069	0,32
Santander UK Group Holdings PLC				
4,750 % éch. 15/09/2025		600	536	0,03
Société Générale S.A.				
1,250 % éch. 15/02/2024	€	7 300	7 128	0,37
Toronto-Dominion Bank				
1,707 % éch. 28/07/2025		5 100	4 887	0,26
TP ICAP Finance PLC				
5,250 % éch. 26/01/2024	£	4 039	4 449	0,23
UBS Group AG				
1,250 % éch. 17/04/2025	€	1 600	1 539	0,08
UniCredit SpA				
1,625 % éch. 03/07/2025		7 700	7 406	0,39
3,127 % éch. 03/06/2032	$	4 400	3 108	0,16
7,830 % éch. 04/12/2023		3 400	3 219	0,17
Vonovia Finance BV				
5,000 % éch. 02/10/2023		500	462	0,02
			436 993	22,84
INDUSTRIE				
Atlantia SpA				
1,875 % éch. 12/02/2028	€	10 150	8 463	0,44
Bacardi Ltd.				
2,750 % éch. 03/07/2023		1 000	998	0,05
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide				
1,625 % éch. 09/07/2024		6 000	5 809	0,30
GN Store Nord A/S				
0,875 % éch. 25/11/2024		3 300	2 972	0,16
Holding d'Infrastructures de Transport SASU				
1,475 % éch. 18/01/2031		4 900	3 834	0,20
Informa PLC				
1,500 % éch. 05/07/2023		1 476	1 464	0,08
Market Bidco Finco PLC				
4,750 % éch. 04/11/2027		4 600	3 712	0,20
Molnlycke Holding AB				
1,750 % éch. 28/02/2024		400	391	0,02
1,875 % éch. 28/02/2025		400	382	0,02
Nissan Motor Co. Ltd.				
1,940 % éch. 15/09/2023		4 400	4 342	0,23
Oracle Corp.				
3,600 % éch. 01/04/2040	$	2 800	1 934	0,10
3,600 % éch. 01/04/2050		3 000	1 904	0,10
3,850 % éch. 01/04/2060		1 200	752	0,04
Owens Corning				
4,300 % éch. 15/07/2047		622	451	0,02
Teleperformance				
1,875 % éch. 02/07/2025	€	200	189	0,01
Ubisoft Entertainment S.A.				
0,878 % éch. 24/11/2027		2 300	1 785	0,09
1,289 % éch. 30/01/2023		4 400	4 390	0,23
			43 772	2,29
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
Électricité de France S.A.				
2,625 % éch. 01/12/2027 (e)		6 600	5 165	0,27
2,875 % éch. 15/12/2026 (e)		12 800	10 529	0,55
Verizon Communications, Inc.				
3,875 % éch. 08/02/2029	$	2 000	1 762	0,09
			17 456	0,91
Total des Obligations et billets privés			498 221	26,04
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Fannie Mae				
3,821 % éch. 25/07/2037		5	4	0,00
4,789 % éch. 25/06/2036		33	31	0,00

Tableau des investissements Fonds Euro Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Freddie Mac					
0,000 % éch. 15/01/2038 (a)	$	525	€	18	0,00
3,358 % éch. 15/01/2038		525		492	0,03
3,500 % éch. 01/10/2047		2 761		2 405	0,13
3,756 % éch. 01/09/2037		951		906	0,05
Ginnie Mae					
4,292 % éch. 20/08/2066		6		6	0,00
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)					
4,500 % éch. 01/10/2029 - 01/08/2041		585		544	0,03
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA					
3,000 % éch. 01/02/2053		32 600		26 838	1,40
4,000 % éch. 01/02/2053		64 700		56 892	2,97
4,500 % éch. 01/02/2053		14 400		12 989	0,68
				101 125	5,29
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN					
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d)					
0,125 % éch. 15/02/2051		6 409		3 874	0,20
0,500 % éch. 15/01/2028		9 302		8 199	0,43
1,000 % éch. 15/02/2048		3 867		3 053	0,16
1,625 % éch. 15/10/2027		30 076		28 161	1,47
				43 287	2,26
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX					
Adjustable Rate Mortgage Trust					
3,208 % éch. 25/01/2036 ^		6		5	0,00
Alba PLC					
3,607 % éch. 25/11/2042	£	283		303	0,02
3,692 % éch. 15/12/2038		3 315		3 478	0,18
American Home Mortgage Investment Trust					
6,500 % éch. 25/03/2047	$	417		291	0,02
Avon Finance PLC					
4,331 % éch. 20/09/2048	£	4 525		5 004	0,26
Banc of America Funding Trust					
4,953 % éch. 20/05/2047	$	63		52	0,00
Barley Hill PLC					
4,352 % éch. 27/08/2058	£	1 721		1 921	0,10
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust					
2,918 % éch. 25/07/2036	$	230		150	0,01
3,653 % éch. 25/07/2033		4		4	0,00
5,230 % éch. 25/10/2035		26		23	0,00
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust					
5,219 % éch. 26/12/2046 ^		70		48	0,00
Canterbury Finance PLC					
4,335 % éch. 16/05/2057	£	611		688	0,04
Charter Mortgage Funding PLC					
3,935 % éch. 16/01/2057		1 810		2 027	0,11
Chase Mortgage Finance Trust					
3,643 % éch. 25/01/2036	$	2 224		1 824	0,10
6,000 % éch. 25/05/2037 ^		92		45	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust					
2,358 % éch. 25/03/2034		1		1	0,00
6,470 % éch. 25/11/2035		14		12	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.					
4,575 % éch. 25/08/2035 ^		291		250	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates					
2,994 % éch. 25/09/2035 ^		510		407	0,02
Countrywide Alternative Loan Trust					
3,048 % éch. 25/12/2035		3		3	0,00
3,594 % éch. 25/06/2037 ^		40		32	0,00
4,809 % éch. 25/07/2046		122		100	0,01
4,839 % éch. 25/09/2035 ^		1 473		854	0,04
5,013 % éch. 20/11/2035		275		226	0,01
5,250 % éch. 25/06/2035 ^		4		3	0,00
6,000 % éch. 25/03/2036 ^		195		86	0,00
6,000 % éch. 25/08/2037 ^		293		144	0,01
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust					
2,980 % éch. 25/04/2035		95		69	0,00
3,229 % éch. 20/05/2036 ^		48		41	0,00
4,969 % éch. 25/04/2035		112		91	0,01
5,029 % éch. 25/03/2035		149		113	0,01
5,129 % éch. 25/02/2035		152		118	0,01
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust					
4,769 % éch. 25/08/2047		3 161		2 304	0,12
Dilosk RMBS DAC					
2,552 % éch. 20/02/2060	€	3 686	€	3 660	0,19
2,747 % éch. 20/12/2060		5 107		5 046	0,26
Dutch Property Finance BV					
2,208 % éch. 28/04/2051		2 189		2 182	0,11
2,228 % éch. 28/07/2058		2 576		2 543	0,13
2,278 % éch. 28/04/2059		4 330		4 263	0,22
2,328 % éch. 28/10/2059		4 319		4 255	0,22
2,828 % éch. 28/04/2050		3 970		3 889	0,20
EMF-UK PLC					
4,491 % éch. 13/03/2046	£	4 593		5 067	0,27
European Loan Conduit DAC					
2,803 % éch. 17/02/2030	€	5 183		4 958	0,26
Eurosail PLC					
2,155 % éch. 13/03/2045		853		836	0,04
Finsbury Square PLC					
4,209 % éch. 16/03/2070	£	3 542		3 983	0,21
4,419 % éch. 16/12/2069		1 957		2 206	0,12
4,709 % éch. 16/06/2070		2 229		2 508	0,13
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust					
3,605 % éch. 25/03/2035	$	32		19	0,00
Glenbeigh Issuer DAC					
2,875 % éch. 24/03/2046	€	1 288		1 267	0,07
2,875 % éch. 24/06/2050		3 105		3 017	0,16
Great Hall Mortgages PLC					
2,192 % éch. 18/03/2039		207		204	0,01
3,695 % éch. 18/06/2038	£	56		62	0,00
4,868 % éch. 18/06/2039	$	51		46	0,00
GSR Mortgage Loan Trust					
3,796 % éch. 25/01/2036 ^		4		3	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust					
3,346 % éch. 19/05/2033		3		3	0,00
Harbour Energy PLC					
3,844 % éch. 28/01/2054	£	4 975		5 518	0,29
Hops Hill PLC					
4,732 % éch. 27/11/2054		3 266		3 593	0,19
IndyMac Mortgage Loan Trust					
3,196 % éch. 25/11/2035 ^	$	82		66	0,00
4,769 % éch. 25/09/2046		569		463	0,02
Jubilee Place BV					
2,378 % éch. 17/10/2057	€	1 972		1 956	0,10
Kentmere PLC					
3,844 % éch. 28/01/2042	£	1 366		1 470	0,08
Lanebrook Mortgage Transaction PLC					
4,487 % éch. 12/06/2057		2 526		2 833	0,15
Mansard Mortgages PLC					
4,172 % éch. 15/12/2049		998		1 081	0,06
MASTR Asset Securitization Trust					
6,000 % éch. 25/06/2036 ^	$	95		60	0,00
Miravet SARL					
2,758 % éch. 26/05/2065	€	5 281		5 105	0,27
Newgate Funding PLC					
4,796 % éch. 15/12/2050	£	246		258	0,01
Paragon Mortgages PLC					
4,290 % éch. 15/05/2045		992		1 112	0,06
Polaris PLC					
4,222 % éch. 23/12/2058		3 696		4 064	0,21
4,232 % éch. 23/10/2059		3 445		3 797	0,20
4,682 % éch. 27/05/2057		3 997		4 490	0,23
Precise Mortgage Funding PLC					
4,587 % éch. 12/12/2055		5 580		6 240	0,33
Primrose Residential DAC					
2,644 % éch. 24/03/2061	€	9 509		9 287	0,49
2,894 % éch. 24/10/2061		5 744		5 599	0,29
Residential Accredit Loans, Inc. Trust					
4,709 % éch. 25/03/2047	$	1 044		861	0,05
4,749 % éch. 25/07/2036 ^		1 221		486	0,03
4,749 % éch. 25/06/2046		322		70	0,00
6,000 % éch. 25/05/2037 ^		47		35	0,00
6,000 % éch. 25/06/2037 ^		343		246	0,01
Residential Asset Securitization Trust					
5,750 % éch. 25/02/2036		1 317		948	0,05
Residential Mortgage Securities PLC					
4,681 % éch. 20/06/2070	£	4 604		5 170	0,27
Resloc UK PLC					
2,206 % éch. 15/12/2043	€	798		762	0,04
Ripon Mortgages PLC					
4,011 % éch. 28/08/2056	£	7 406	€	8 192	0,43
RMAC PLC					
4,206 % éch. 12/06/2046		157		176	0,01
RMAC Securities PLC					
3,656 % éch. 12/06/2044		63		65	0,00
3,676 % éch. 12/06/2044		1 089		1 125	0,06
Shamrock Residential DAC					
2,744 % éch. 24/12/2059	€	1 881		1 852	0,10
Stanlington PLC					
4,337 % éch. 12/06/2045	£	3 866		4 269	0,22
Stratton Mortgage Funding PLC					
3,826 % éch. 20/07/2060		15 607		17 441	0,91
4,287 % éch. 12/03/2052		5 721		6 422	0,34
4,292 % éch. 25/09/2051		3 595		4 000	0,21
Structured Asset Mortgage Investments Trust					
1,567 % éch. 25/02/2036 ^	$	192		143	0,01
4,769 % éch. 25/06/2036		49		44	0,00
4,839 % éch. 19/07/2035		3		3	0,00
5,039 % éch. 19/12/2034		64		54	0,00
5,039 % éch. 19/02/2035		68		58	0,00
Towd Point Mortgage Funding PLC					
3,596 % éch. 20/10/2051	£	500		550	0,03
3,826 % éch. 20/07/2045		4 265		4 735	0,25
4,071 % éch. 20/10/2051		8 265		9 261	0,48
4,171 % éch. 20/05/2045		7 855		8 721	0,46
4,471 % éch. 20/02/2054		2 123		2 384	0,12
Tower Bridge Funding PLC					
4,051 % éch. 20/11/2063		6 676		7 381	0,39
Trinity Square PLC					
3,729 % éch. 15/07/2059		7 272		8 102	0,42
Tudor Rose Mortgages					
4,031 % éch. 20/06/2048		3 207		3 564	0,19
Twin Bridges PLC					
4,637 % éch. 12/12/2054		5 783		6 491	0,34
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
3,342 % éch. 25/05/2037 ^	$	678		553	0,03
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
2,798 % éch. 25/02/2047 ^		2 626		2 083	0,11
Wells Fargo Alternative Loan Trust					
3,563 % éch. 25/07/2037 ^		24		20	0,00
				233 993	12,23
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS					
Accunia European CLO DAC					
2,328 % éch. 15/07/2030	€	6 509		6 381	0,33
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust					
4,689 % éch. 25/07/2036	$	538		189	0,01
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					
5,094 % éch. 25/01/2036		433		404	0,02
Aqueduct European CLO DAC					
2,096 % éch. 20/07/2030	€	5 115		5 014	0,26
Ares European CLO DAC					
1,988 % éch. 15/04/2030		3 212		3 126	0,16
2,038 % éch. 15/10/2030		4 685		4 573	0,24
2,582 % éch. 21/10/2033		4 000		3 919	0,21
Asset-Backed Funding Certificates Trust					
5,389 % éch. 25/06/2037	$	74		55	0,00
Aurium CLO DAC					
2,048 % éch. 16/04/2030	€	6 077		5 957	0,31
2,108 % éch. 16/01/2031		4 598		4 497	0,24
Auto ABS French Leases FCT					
2,595 % éch. 29/06/2033		7 280		7 275	0,38
Bain Capital Euro CLO DAC					
2,196 % éch. 20/01/2032		4 800		4 677	0,24
Bavarian Sky S.A.					
2,448 % éch. 20/05/2027		1 084		1 085	0,06
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust					
6,189 % éch. 25/07/2035	$	665		602	0,03
Black Diamond CLO DAC					
2,834 % éch. 03/10/2029	€	149		148	0,01
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC					
1,050 % éch. 15/01/2031		100		90	0,01
2,028 % éch. 15/07/2030		2 661		2 599	0,14

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
2,098 % éch. 15/01/2031	€	4 598	€	4 473	0,23
2,228 % éch. 15/01/2033		2 000		1 926	0,10
BNPP AM Euro CLO DAC					
2,028 % éch. 15/10/2031		1 036		1 015	0,05
Bridgepoint CLO DAC					
2,588 % éch. 15/01/2034		1 600		1 566	0,08
Bumper UK Finance PLC					
3,900 % éch. 20/12/2030	£	2 952		3 325	0,17
Cairn CLO DAC					
2,253 % éch. 25/04/2032	€	1 400		1 365	0,07
2,275 % éch. 31/01/2030		4 821		4 726	0,25
2,333 % éch. 25/07/2029		2 037		2 020	0,11
2,688 % éch. 20/10/2028		145		142	0,01
Carlyle Euro CLO DAC					
2,428 % éch. 15/08/2030		7 423		7 246	0,38
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC					
2,273 % éch. 25/01/2032		4 998		4 894	0,26
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.					
2,548 % éch. 15/11/2031		4 600		4 458	0,23
Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC					
2,506 % éch. 15/12/2029		3 307		3 303	0,17
Compartment VCL					
2,497 % éch. 21/01/2028		2 746		2 754	0,14
Contego CLO BV					
2,148 % éch. 15/10/2030		3 748		3 664	0,19
Contego CLO DAC					
2,142 % éch. 23/01/2030		4 592		4 475	0,23
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust					
4,486 % éch. 25/07/2036	$	69		61	0,00
4,529 % éch. 25/06/2035		4 223		3 575	0,19
4,609 % éch. 25/06/2047		3 311		2 958	0,16
4,649 % éch. 25/11/2037		2 048		1 694	0,09
5,229 % éch. 25/10/2047		1 202		1 086	0,06
CVC Cordatus Loan Fund DAC					
2,028 % éch. 15/10/2031	€	3 400		3 302	0,17
2,578 % éch. 15/08/2032		3 300		3 217	0,17
Ellington Loan Acquisition Trust					
5,439 % éch. 25/05/2037	$	2 843		2 530	0,13
FACT Master S.A.					
2,248 % éch. 20/11/2025	€	143		143	0,01
FCT Pulse France					
2,198 % éch. 25/01/2035		2 900		2 903	0,15
First Franklin Mortgage Loan Trust					
4,549 % éch. 25/11/2036	$	154		141	0,01
Grosvenor Place CLO BV					
2,325 % éch. 30/10/2029	€	1 578		1 561	0,08
Harvest CLO DAC					
2,018 % éch. 15/10/2031		5 600		5 443	0,29
2,136 % éch. 20/10/2031		4 300		4 176	0,22
2,138 % éch. 15/07/2031		5 400		5 215	0,27
2,228 % éch. 15/01/2032		8 300		8 042	0,42
2,433 % éch. 18/11/2029		443		437	0,02
Invesco Euro CLO DAC					
2,028 % éch. 15/07/2031		1 550		1 506	0,08
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust					
4,659 % éch. 25/07/2036	$	78		60	0,00
Jubilee CLO DAC					
2,128 % éch. 12/07/2028	€	206		205	0,01
2,846 % éch. 15/12/2029		4 920		4 828	0,25
Laurelin DAC					
2,176 % éch. 20/10/2031		6 000		5 817	0,30
Lehman XS Trust					
6,500 % éch. 25/06/2046	$	2 406		1 829	0,10
Long Beach Mortgage Loan Trust					
4,689 % éch. 25/05/2036		2 109		1 150	0,06
4,689 % éch. 25/06/2036		4 846		2 261	0,12
Man GLG Euro CLO DAC					
2,058 % éch. 15/10/2030	€	2 910		2 843	0,15
2,188 % éch. 15/10/2032		4 298		4 158	0,22
2,248 % éch. 15/01/2030		6 517		6 372	0,33
MASTR Asset-Backed Securities Trust					
4,539 % éch. 25/10/2036	$	3 049		937	0,05
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust					
4,639 % éch. 25/07/2036		353		280	0,02
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust					
4,529 % éch. 25/12/2036		2 836		1 349	0,07
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust					
4,539 % éch. 25/07/2036	$	536	€	452	0,02
5,004 % éch. 25/02/2036		5		4	0,00
NovaStar Mortgage Funding Trust					
4,589 % éch. 25/09/2037		506		458	0,02
5,094 % éch. 25/01/2036		139		128	0,01
OCP Euro CLO DAC					
2,198 % éch. 15/01/2032	€	4 100		4 025	0,21
2,382 % éch. 22/09/2034		5 600		5 443	0,28
Palmer Square European Loan Funding DAC					
2,098 % éch. 15/10/2031		7 334		7 112	0,37
PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartment					
2,594 % éch. 26/11/2030		3 167		3 168	0,17
Purple Master Credit Cards					
2,594 % éch. 25/05/2034		6 300		6 301	0,33
Sculptor European CLO DAC					
2,153 % éch. 14/01/2032		4 600		4 477	0,23
Silver Arrow Merfina SRL					
2,448 % éch. 20/07/2033		4 490		4 489	0,24
Silver Arrow S.A.					
2,386 % éch. 15/02/2027		595		596	0,03
SLC Student Loan Trust					
5,574 % éch. 25/11/2042	$	781		726	0,04
SLM Student Loan Trust					
1,943 % éch. 25/10/2039	€	475		450	0,02
Soundview Home Loan Trust					
4,889 % éch. 25/10/2036	$	5 173		4 597	0,24
Tikehau CLO DAC					
2,596 % éch. 04/08/2034	€	4 000		3 883	0,20
Toro European CLO DAC					
2,239 % éch. 12/01/2032		3 900		3 757	0,20
Turbo Finance PLC					
4,230 % éch. 20/08/2028	£	1 847		2 082	0,11
Voya Euro CLO DAC					
2,128 % éch. 15/10/2030	€	3 199		3 131	0,16
				237 301	12,40
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Agence Française de Développement					
0,125 % éch. 29/09/2031		2 200		1 656	0,09
Communauté autonome de Catalogne					
4,220 % éch. 26/04/2035		1 600		1 555	0,08
Obligation internationale du gouvernement belge					
1,400 % éch. 22/06/2053		21 500		13 455	0,70
1,600 % éch. 22/06/2047		18 000		12 661	0,66
Caisse Française de Financement Local					
1,958 % éch. 25/02/2025		9 600		9 534	0,50
Obligation internationale du gouvernement français					
0,100 % éch. 25/07/2031 (d)		3 451		3 304	0,17
0,100 % éch. 25/07/2038 (d)		9 825		8 808	0,46
0,500 % éch. 25/05/2072		6 700		2 499	0,13
0,750 % éch. 25/05/2052		3 900		2 060	0,11
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro					
0,400 % éch. 15/05/2030 (d)		4 198		3 676	0,19
1,300 % éch. 15/05/2028 (d)		14 200		13 731	0,72
2,150 % éch. 01/09/2052		19 000		11 351	0,59
2,800 % éch. 01/03/2067		21 300		14 155	0,74
3,850 % éch. 01/09/2049		10 500		9 074	0,47
Obligation internationale du gouvernement japonais					
0,100 % éch. 01/03/2023	¥	9 056 000		64 329	3,36
Korea Housing Finance Corp.					
0,723 % éch. 22/03/2025	€	4 500		4 216	0,22
Obligation internationale du gouvernement mexicain					
2,659 % éch. 24/05/2031	$	9 700		7 353	0,38
République d'Allemagne					
0,000 % éch. 15/08/2050 (b)(h)	€	4 200		2 157	0,11
Obligation internationale du gouvernement roumain					
2,000 % éch. 28/01/2032		7 700		5 165	0,27
Obligation internationale du gouvernement slovène					
0,000 % éch. 12/02/2031 (b)		6 100		4 509	0,24
1,000 % éch. 06/03/2028		3 600		3 214	0,17
1,175 % éch. 13/02/2062		8 410		4 147	0,22
3,125 % éch. 07/08/2045		7 000		6 044	0,32
5,250 % éch. 18/02/2024	$	21 451		20 096	1,05
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen					
0,000 % éch. 16/09/2025 (b)	€	4 400	€	4 012	0,21
Obligation internationale du gouvernement espagnol					
0,000 % éch. 31/01/2026 (b)		8 400		71 462	3,74
0,100 % éch. 30/04/2031		3 600		2 742	0,14
1,400 % éch. 30/07/2028		19 200		17 454	0,91
1,450 % éch. 31/10/2027		23 300		21 555	1,13
1,900 % éch. 31/10/2052		19 200		12 233	0,64
1,950 % éch. 30/04/2026		4 600		4 446	0,23
2,550 % éch. 31/10/2032		7 400		6 751	0,35
3,450 % éch. 30/07/2043		9 100		8 390	0,44
3,450 % éch. 30/07/2066		9 400		8 314	0,44
				386 108	20,18

ACTIONS

TITRES PRIVILÉGIÉS					
Nationwide Building Society					
10,250 %		9 139		1 290	0,07

		VALEUR NOMINALE (en milliers)			
INSTRUMENTS À COURT TERME					
BILLETS DE TRÉSORERIE					
Acciona Energia Financiacion Filiales S.A.					
2,078 % éch. 16/01/2023	€	8 000		7 992	0,42
Fiserv, Inc.					
1,673 % éch. 05/01/2023		2 000		1 999	0,11
Nomura Bank International PLC					
2,078 % éch. 28/02/2023		6 300		6 277	0,33
SGS Nederland Holding BV					
2,099 % éch. 30/01/2023		5 700		5 690	0,30
2,109 % éch. 12/01/2023		6 000		5 996	0,31
2,210 % éch. 19/01/2023		5 000		4 994	0,26
Universal Music Group NV					
2,099 % éch. 13/02/2023		4 300		4 290	0,22
				37 238	1,95
BONS DU TRÉSOR DU MÉCANISME EUROPÉEN DE STABILISATION					
0,253 % éch. 19/01/2023 (b)(c)		3 000		2 998	0,16
0,274 % éch. 19/01/2023 (b)(c)		1 400		1 399	0,07
0,304 % éch. 19/01/2023 (b)(c)		3 600		3 598	0,19
0,578 % éch. 13/04/2023 (b)(c)		7 000		6 958	0,36
1,541 % éch. 09/02/2023 (b)(c)		1 100		1 098	0,06
1,876 % éch. 20/04/2023 (b)(c)		4 510		4 481	0,23
2,212 % éch. 18/05/2023 (b)(c)		2 895		2 870	0,15
2,231 % éch. 18/05/2023 (b)(c)		5 790		5 739	0,30
				29 141	1,52
BONS DU TRÉSOR DE L'UNION EUROPÉENNE					
1,369 % éch. 03/03/2023 (b)(c)		3 100		3 091	0,16
1,587 % éch. 07/04/2023 (b)(c)		7 250		7 211	0,38
1,632 % éch. 03/03/2023 (b)(c)		4 550		4 537	0,24
1,649 % éch. 03/03/2023 (b)(c)		4 550		4 537	0,24
1,866 % éch. 07/04/2023 (b)(c)		600		597	0,03
1,876 % éch. 07/04/2023 (b)(c)		2 200		2 188	0,11
				22 161	1,16
BONS DU TRÉSOR ALLEMAND					
1,257 % éch. 22/02/2023 (b)(c)(h)		1 889		1 885	0,10
1,658 % éch. 22/03/2023 (b)(c)(h)		317		316	0,02
				2 201	0,12
BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN					
0,011 % éch. 04/01/2023 (b)(c)	ILS	4 000		1 062	0,05
0,022 % éch. 04/01/2023 (b)(c)		10 300		2 734	0,14
0,156 % éch. 04/01/2023 (b)(c)		2 600		690	0,04
				4 486	0,23
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS					
(0,249) % éch. 11/01/2023 (b)(c)	¥	273 000		1 939	0,10
(0,242) % éch. 23/01/2023 (b)(c)		2 121 000		15 064	0,79
(0,182) % éch. 20/03/2023 (b)(c)		3 427 000		24 345	1,27
(0,171) % éch. 20/03/2023 (b)(c)		2 323 000		16 503	0,86

Tableau des investissements Fonds Euro Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
(0,160) % éch. 30/01/2023 (b)(c)	¥	4 033 500	€	28 647	1,50
(0,149) % éch. 30/01/2023 (b)(c)		1 846 500		13 114	0,68
(0,117) % éch. 20/02/2023 (b)(c)		7 240 000		51 426	2,69
				151 038	7,89
Total des Instruments à court terme				246 265	12,87
Total des Valeurs mobilières			**€**	**1 747 790**	**91,35**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (f)	1 908 200	€ 181 654	9,49
Total des Fonds d'investissement		**€ 181 654**	**9,49**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BPS	(1,000) %	30/12/2022	02/01/2023	€ 10 900	BNG Bank NV 0,125 % échéance 19/04/2033	€ (11 063)	€ 10 900	€ 10 899	0,57
FICC	1,900	30/12/2022	03/01/2023	$ 656	Billets du Trésor américain 0,125 % échéance 15/05/2023	(627)	615	615	0,03
Total des Contrats de mise en pension						**€ (11 690)**	**€ 11 515**	**€ 11 514**	**0,60**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois mars	Long	03/2023	1 046	€ (8 316)	(0,43)
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	45	34	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Long	03/2023	3 137	(10 666)	(0,56)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	Long	03/2023	516	(4 170)	(0,22)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	2 316	15 823	0,83
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	Long	03/2023	329	(8 442)	(0,44)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars	Long	03/2023	1 595	(15 352)	(0,80)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars	Long	03/2023	2 331	(3 260)	(0,17)
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Court	03/2023	5	98	0,01
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	45	(216)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Court	03/2023	129	(33)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Court	03/2023	242	229	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	1 115	(906)	(0,05)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Long	03/2023	135	(143)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	1 715	2 377	0,12
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Court	03/2023	70	515	0,03
				€ (32 428)	(1,69)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**€ (32 428)**	**(1,69)**

(1) Option de style contrat à terme standardisé.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
British Telecommunications PLC	1,000 %	20/12/2027	€ 100	€ (2)	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION[2]

Indices/Tranches	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.HY-38 à 5 ans	(5,000) %	20/06/2027	$ 22 671	€ (228)	(0,01)
Indice iTraxx Crossover 37 à 5 ans	(5,000)	20/06/2027	€ 49 600	(2 265)	(0,12)
				€ (2 493)	(0,13)

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance		Montant notionnel		Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000 %	15/03/2053	£	1 000	€	10	0,00
À payer[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250	15/03/2028		27 700		(802)	(0,04)
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500	12/12/2027		20 600		(198)	(0,01)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	16/06/2029	¥	7 571 000		954	0,05
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,435	20/06/2029		2 729 000		290	0,02
À payer	EURIBOR EUR à 3 mois	0,526	21/11/2023	€	124 100		(4 239)	(0,22)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,880	25/01/2052	$	11 900		(3 244)	(0,17)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,000	08/11/2032	€	20 310		(5 103)	(0,27)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,195	04/11/2052		11 660		5 508	0,29
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,197	08/11/2052		6 760		2 769	0,15
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024		5 200		(209)	(0,01)
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2025		105 800		2 152	0,11
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028		177 000		(7 967)	(0,42)
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053		26 800		1 914	0,10
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033		245 900		(7 126)	(0,37)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,800	27/10/2032		16 000		(1 542)	(0,08)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,960	27/10/2032		17 100		(1 384)	(0,07)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	21/09/2037		46 800		(2 581)	(0,13)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	21/09/2042		21 400		(1 289)	(0,07)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	12/12/2032		20 600		(687)	(0,04)
À payer	CPTFEMU	1,380	15/03/2031		28 500		(5 539)	(0,29)
À recevoir	CPTFEMU	2,359	15/08/2030		2 800		78	0,00
À payer	CPTFEMU	2,421	15/05/2052		990		(108)	(0,01)
À recevoir	CPTFEMU	2,470	15/07/2032		2 300		82	0,00
À payer	CPTFEMU	2,488	15/05/2037		6 880		(383)	(0,02)
À recevoir	CPTFEMU	2,600	15/05/2032		4 500		153	0,01
À recevoir	CPTFEMU	2,720	15/06/2032		6 600		103	0,01
À recevoir	CPTFEMU	2,975	15/08/2027		6 700		48	0,00
À recevoir	CPTFEMU	3,340	15/08/2027		25 900		(182)	(0,01)
À recevoir	CPURNSA	3,479	18/07/2023	$	26 800		44	0,00
						€	(28 478)	(1,49)
Total des Instruments financiers dérivés compensés						**€**	**(30 973)**	**(1,62)**

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

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

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

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

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

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

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]		Coût		Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,000 %	15/03/2023	10 600	€	990	€	5 381	0,28
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,410	02/02/2023	133 600		592		0	0,00
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,720	23/02/2023	27 600		134		0	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,200	26/04/2023	22 500		228		13	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,710	25/01/2023	29 400		158		0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,000	15/03/2023	8 500		773		4 315	0,23
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,428	31/01/2023	133 200		607		0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,200	31/05/2023	63 600		724		71	0,00
							€	4 206	€	9 780	0,51

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]		Prime		Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,175 %	15/03/2023	31 800	€	(967)	€	(9 157)	(0,48)
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,558	02/02/2023	29 200		(591)		0	0,00
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,736	23/02/2023	6 100		(133)		0	0,00

Tableau des investissements Fonds Euro Bond Fund (suite)

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À recevoir	4,290 %	17/01/2023	12 500	€ (536)	€ (648)	(0,03)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À payer	4,290	17/01/2023	12 500	(536)	(28)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,350	26/04/2023	12 400	(232)	(20)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547	07/03/2023	6 700	(140)	(14)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	6 700	(140)	(395)	(0,02)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	7 700	(87)	(18)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	7 700	(100)	(236)	(0,01)
GST	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,950	05/01/2023	26 200	(689)	(7)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,950	05/01/2023	26 200	(689)	(556)	(0,03)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	3,230	18/01/2023	16 000	(437)	(169)	(0,01)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,230	18/01/2023	16 000	(437)	(128)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À recevoir	4,670	10/01/2023	12 700	(520)	(1 075)	(0,06)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À payer	4,670	10/01/2023	12 700	(520)	(2)	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,785	25/01/2023	6 500	(159)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,175	15/03/2023	25 500	(760)	(7 343)	(0,38)
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,579	31/01/2023	29 100	(607)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,350	31/05/2023	35 000	(723)	(97)	(0,01)
							€ (9 003)	€ (19 893)	(1,04)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000 %	20/12/2023	$ 200	€ (8)	€ 8	€ 0	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/06/2024	16 800	(655)	626	(29)	0,00
					€ (663)	€ 634	€ (29)	0,00

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

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

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	9 442	€	8 932	€ 89	€ 0	€ 89	0,00
	02/2023	€	7 120	£	6 164	0	(185)	(185)	(0,01)
	02/2023	£	1 350	€	1 526	7	0	7	0,00
	02/2023	¥	264 800		1 838	0	(47)	(47)	0,00
BPS	02/2023	IDR	410 179	$	26	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	$	1 283	CNH	8 943	11	0	11	0,00
	01/2023		11 213	€	10 751	249	0	249	0,01
	02/2023	€	1 965	£	1 709	0	(43)	(43)	0,00
	03/2023	¥	5 750 000	€	40 147	0	(889)	(889)	(0,05)
CBK	01/2023	DKK	622 337		83 703	11	0	11	0,00
	01/2023	€	1 854	$	1 974	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	ILS	16 894		5 359	535	0	535	0,03
	01/2023	$	16 518	€	15 691	221	0	221	0,01
	02/2023	€	7 393	£	6 531	0	(45)	(45)	0,00
	03/2023	$	463	MXN	9 083	0	(3)	(3)	0,00
GLM	01/2023		1 334	CNH	9 283	8	0	8	0,00
JPM	01/2023	€	2 444	DKK	18 170	0	0	0	0,00
	01/2023	¥	273 000	€	1 908	0	(31)	(31)	0,00
	01/2023	$	4 139		3 904	27	0	27	0,00
	02/2023	AUD	170		110	2	0	2	0,00
	02/2023	€	1 813	£	1 563	0	(54)	(54)	0,00
	02/2023	IDR	708 482	$	45	0	(1)	(1)	0,00
	03/2023		758 490		48	0	(1)	(1)	0,00
MBC	01/2023	€	995	DKK	7 400	0	0	0	0,00
	01/2023		3 822	$	4 034	0	(44)	(44)	0,00
	01/2023	¥	5 880 000	€	40 246	0	(1 576)	(1 576)	(0,08)
	01/2023	$	161 461		154 007	2 787	0	2 787	0,15
	02/2023	AUD	54		35	1	0	1	0,00
	02/2023	¥	7 240 000		50 401	0	(1 169)	(1 169)	(0,06)
	03/2023	IDR	460 358	$	29	0	0	0	0,00
	05/2023	CNH	19 033		2 836	54	0	54	0,00
MYI	01/2023	€	5	CHF	4	0	0	0	0,00
	01/2023		6 928	$	7 284	0	(105)	(105)	(0,01)
	01/2023	$	4 519	€	4 297	64	0	64	0,00
	02/2023	€	1 550	¥	217 077	6	(10)	(4)	0,00
	03/2023	IDR	648 633	$	41	0	(1)	(1)	0,00
RBC	02/2023	€	2 222	£	1 949	0	(29)	(29)	0,00
	04/2023	MXN	310	$	15	0	(1)	(1)	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
RYL	01/2023	¥	2 121 000	€	14 855	€ 0	€ (224)	€ (224)	(0,01)
	02/2023	£	848		980	26	0	26	0,00
SCX	01/2023	KRW	173 486	$	131	0	(6)	(6)	0,00
	02/2023	€	1 063	£	933	0	(14)	(14)	0,00
	02/2023	IDR	745 478	$	47	0	(1)	(1)	0,00
SSB	02/2023	£	192 475	€	219 304	2 746	0	2 746	0,14
UAG	02/2023	IDR	1 106 392	$	70	0	(2)	(2)	0,00
	03/2023	¥	9 060 528	€	63 614	0	(960)	(960)	(0,05)
						€ 6 844	€ (5 446)	€ 1 398	0,07

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
CBK	01/2023	€	109 727	CHF	108 039	€ 0	€ (288)	€ (288)	(0,01)
MBC	01/2023		109 729		108 039	0	(289)	(289)	(0,01)
RBC	01/2023	CHF	4	€	5	0	0	0	0,00
	01/2023	€	345	CHF	340	0	0	0	0,00
RYL	01/2023		143		141	0	0	0	0,00
SCX	01/2023		109 764		108 071	0	(292)	(292)	(0,02)
						€ 0	€ (869)	€ (869)	(0,04)

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**€**	**(9 613)**	**(0,50)**
Total des Investissements	**€**	**1 867 945**	**97,63**
Autres actifs et passifs à court terme	**€**	**45 330**	**2,37**
Actif net	**€**	**1 913 275**	**100,00**

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

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

(f) Affilié au Fonds.

(g) Titre convertible conditionnel.

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 4 360 € (31 décembre 2021 : 8 559 €) et un montant en numéraire de 5 628 € (31 décembre 2021 : 3 399 €) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Un montant en numéraire de 53 376 € (31 décembre 2021 : 26 110 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	€ 0	€ 1 747 790	€ 0	€ 1 747 790
Fonds d'investissement	180 784	870	0	181 654
Contrats de mise en pension	0	11 515	0	11 515
Instruments financiers dérivés[3]	(33 951)	(39 063)	0	(73 014)
Totaux	**€ 146 833**	**€ 1 721 112**	**€ 0**	**€ 1 867 945**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	€ 0	€ 2 354 423	€ 0	€ 2 354 423
Fonds d'investissement	0	167 438	0	167 438
Contrats de mise en pension	0	24 716	0	24 716
Instruments financiers dérivés[3]	(10 991)	(22 207)	0	(33 198)
Totaux	**€ (10 991)**	**€ 2 524 370**	**€ 0**	**€ 2 513 379**

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

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

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	€ (136)	€ 0	€ (136)	€ (72)	€ 0	€ (72)
BPS	(3 776)	1 243	(2 533)	(905)	830	(75)
BRC	(672)	250	(422)	(60)	90	30
CBK	(250)	0	(250)	(1 771)	1 973	202
DUB	S/O	S/O	S/O	134	0	134
GLM	(662)	553	(109)	597	(550)	47
GSC	S/O	S/O	S/O	(22)	0	(22)
GST	(1 966)	1 883	(83)	(56)	59	3
HUS	S/O	S/O	S/O	(270)	459	189
JPM	(3 086)	3 064	(22)	(403)	330	(73)
MBC	(236)	(390)	(626)	S/O	S/O	S/O
MYC	(26)	70	44	(247)	(1 100)	(1 347)
MYI	(46)	37	(9)	(1 867)	1 091	(776)
RBC	(30)	0	(30)	426	(80)	346
RYL	(198)	30	(168)	(6 655)	6 956	301
SCX	(313)	373	60	2 937	(2 310)	627
SSB	2 746	(1 770)	976	S/O	S/O	S/O
UAG	(962)	(4 040)	(5 002)	S/O	S/O	S/O

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	71,54	87,11
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	19,58	4,14
Autres valeurs mobilières	0,23	0,22
Fonds d'investissement	9,49	6,50
Contrats de mise en pension	0,60	0,96
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(1,69)	(0,46)
Instruments financiers dérivés compensés	(1,62)	(0,51)
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,50)	(0,32)

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Crédits consortiaux et cessions	0,01	0,01
Obligations et billets privés	26,04	35,59
Agences du gouvernement américain	5,29	0,30
Obligations du Trésor américain	2,26	3,32
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	12,23	10,40
Titres adossés à des actifs	12,40	11,76
Émissions souveraines	20,18	26,92
Titres privilégiés	0,07	0,08
Instruments à court terme	12,87	3,09
Fonds d'investissement	9,49	6,50
Contrats de mise en pension	0,60	0,96
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(1,69)	(0,46)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection	(0,13)	S/O
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	S/O	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(1,49)	(0,51)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,51	0,35
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	S/O	0,00
Options de change	S/O	(0,01)
Swaptions de taux d'intérêt	(1,04)	(0,68)
Options sur titres	S/O	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,00
Contrats de change à terme	0,07	(0,02)
Contrats de change à terme couverts	(0,04)	0,04
Autres actifs et passifs à court terme	2,37	2,36
Actif net	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Charter Communications Operating LLC				
6,140 % éch. 01/02/2027	$	3 300	€3 024	0,49
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
6,173 % éch. 22/06/2026		3 240	3 030	0,50
INEOS Finance PLC				
3,898 % éch. 01/04/2024	€	2 237	2 233	0,37
			8 287	1,36
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				
ABN AMRO Bank NV				
2,375 % éch. 01/06/2027		4 600	4 318	0,71
2,470 % éch. 13/12/2029	$	2 300	1 746	0,29
Acef Holding S.C.A.				
0,750 % éch. 14/06/2028	€	400	296	0,05
AerCap Ireland Capital DAC				
2,875 % éch. 14/08/2024	$	1 300	1 154	0,19
Altareit S.C.A.				
2,875 % éch. 02/07/2025	€	100	89	0,01
American Tower Corp.				
0,875 % éch. 21/05/2029		400	320	0,05
Aroundtown S.A.				
0,000 % éch. 16/07/2026 (a)		1 300	928	0,15
0,375 % éch. 15/04/2027		900	597	0,10
1,450 % éch. 09/07/2028		100	63	0,01
1,500 % éch. 28/05/2026		1 600	1 229	0,20
ASR Nederland NV				
5,000 % éch. 30/09/2024 (c)		1 300	1 292	0,21
7,000 % éch. 07/12/2043		100	100	0,02
Atrium Finance PLC				
2,625 % éch. 05/09/2027		1 560	1 094	0,18
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.				
3,205 % éch. 15/11/2024		1 200	1 194	0,20
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % éch. 18/11/2027	$	172	129	0,02
3,950 % éch. 01/07/2024		100	90	0,01
Balder Finland Oyj				
1,000 % éch. 18/01/2027	€	1 200	898	0,15
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
2,625 % éch. 28/04/2025		3 900	3 539	0,58
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
6,138 % éch. 14/09/2028	$	4 200	3 947	0,65
Banco de Sabadell S.A.				
1,125 % éch. 27/03/2025	€	100	92	0,02
Banco Santander S.A.				
2,375 % éch. 08/09/2027		1 600	1 529	0,25
Bank of Ireland Group PLC				
1,000 % éch. 25/11/2025		2 100	1 966	0,32
Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.				
0,625 % éch. 19/11/2027		12 300	10 437	1,71
Barclays PLC				
0,577 % éch. 09/08/2029		8 300	6 570	1,08
BNP Paribas S.A.				
0,500 % éch. 04/06/2026		5 400	4 960	0,81
1,904 % éch. 30/09/2028	$	9 000	7 035	1,15
4,400 % éch. 14/08/2028		1 185	1 052	0,17
5,198 % éch. 10/01/2030		500	446	0,07
BPCE S.A.				
0,500 % éch. 15/09/2027	€	8 400	7 287	1,19
CaixaBank S.A.				
3,750 % éch. 07/09/2029		4 500	4 416	0,72
5,375 % éch. 14/11/2030		700	716	0,12
CapitaLand Ascendas REIT				
0,750 % éch. 23/06/2028		100	78	0,01
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund				
0,500 % éch. 27/01/2028		500	387	0,06
0,900 % éch. 12/10/2029		2 300	1 680	0,28
Cooperatieve Rabobank UA				
4,655 % éch. 22/08/2028	$	1 900	1 712	0,28
CPI Property Group S.A.				
1,500 % éch. 27/01/2031	€	4 900	2 844	0,47
Crédit Agricole S.A.				
1,907 % éch. 16/06/2026	$	2 600	€2 223	0,36
Credit Suisse Group AG				
1,250 % éch. 17/07/2025	€	6 900	6 203	1,02
3,869 % éch. 12/01/2029	$	2 100	1 580	0,26
4,194 % éch. 01/04/2031		400	292	0,05
4,282 % éch. 09/01/2028		6 000	4 668	0,77
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % éch. 19/11/2025	€	3 000	2 426	0,40
CTP NV				
0,625 % éch. 27/09/2026		600	462	0,08
0,875 % éch. 20/01/2026		3 100	2 527	0,41
Dell Bank International DAC				
0,500 % éch. 27/10/2026		1 600	1 387	0,23
Deutsche Bank AG				
0,750 % éch. 17/02/2027		3 200	2 794	0,46
1,375 % éch. 03/09/2026		2 100	1 916	0,31
1,625 % éch. 20/01/2027		3 900	3 445	0,56
1,750 % éch. 17/01/2028		2 700	2 312	0,38
2,129 % éch. 24/11/2026 (e)	$	400	331	0,05
2,552 % éch. 07/01/2028		200	160	0,03
2,625 % éch. 12/02/2026	€	2 000	1 890	0,31
Digital Euro Finco LLC				
2,625 % éch. 15/04/2024		2 100	2 040	0,33
EQT AB				
2,375 % éch. 06/04/2028		700	616	0,10
Equitable Financial Life Global Funding				
0,600 % éch. 16/06/2028		2 900	2 395	0,39
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
2,750 % éch. 29/03/2028		7 000	6 126	1,00
Ford Motor Credit Co. LLC				
2,386 % éch. 17/02/2026		1 400	1 281	0,21
2,684 % éch. 01/12/2024		200	193	0,03
2,700 % éch. 10/08/2026	$	400	326	0,05
G City Europe Ltd.				
4,250 % éch. 11/09/2025	€	2 400	2 016	0,33
GA Global Funding Trust				
1,625 % éch. 15/01/2026	$	200	167	0,03
General Motors Financial Co., Inc.				
2,200 % éch. 01/04/2024	€	600	589	0,10
Globalworth Real Estate Investments Ltd.				
3,000 % éch. 29/03/2025		2 700	2 370	0,39
Goldman Sachs Group, Inc.				
0,875 % éch. 09/05/2029		8 100	6 511	1,07
HSBC Holdings PLC				
0,309 % éch. 13/11/2026		100	89	0,01
4,292 % éch. 12/09/2026	$	1 400	1 256	0,21
ING Bank NV				
2,750 % éch. 21/11/2025	€	1 700	1 675	0,27
ING Groep NV				
1,250 % éch. 16/02/2027		200	182	0,03
3,000 % éch. 18/02/2026	£	3 600	3 779	0,62
Intesa Sanpaolo SpA				
4,000 % éch. 23/09/2029	$	3 700	2 973	0,49
5,710 % éch. 15/01/2026		2 300	2 073	0,34
JAB Holdings BV				
1,750 % éch. 25/06/2026	€	1 100	1 025	0,17
4,750 % éch. 29/06/2032		4 300	4 349	0,71
Jyske Realkredit A/S				
0,500 % éch. 01/10/2043	DKK	0	0	0,00
1,000 % éch. 01/10/2050		32 010	3 172	0,52
1,000 % éch. 01/10/2053		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2037		264	31	0,01
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
Kojamo Oyj				
1,500 % éch. 19/06/2024	€	500	475	0,08
LeasePlan Corp. NV				
0,250 % éch. 07/09/2026		2 600	2 231	0,37
Liberty Mutual Finance Europe DAC				
1,750 % éch. 27/03/2024		400	390	0,06
Lloyds Banking Group PLC				
3,511 % éch. 18/03/2026	$	200	178	0,03
3,750 % éch. 18/03/2028		3 700	3 205	0,53
Logicor Financing SARL				
2,250 % éch. 13/05/2025	€	5 500	5 033	0,82
3,250 % éch. 13/11/2028		2 000	1 687	0,28
Mizuho Financial Group, Inc.				
3,490 % éch. 05/09/2027	€	5 300	€5 166	0,85
MPT Operating Partnership LP				
0,993 % éch. 15/10/2026		500	383	0,06
Nationwide Building Society				
4,363 % éch. 01/08/2024	$	10 200	9 434	1,55
NatWest Group PLC				
1,750 % éch. 02/03/2026	€	4 339	4 086	0,67
2,000 % éch. 04/03/2025		4 900	4 781	0,78
NE Property BV				
1,875 % éch. 09/10/2026		200	168	0,03
3,375 % éch. 14/07/2027		4 400	3 818	0,63
Nordea Bank Abp				
1,125 % éch. 16/02/2027		300	272	0,04
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
0,500 % éch. 01/10/2043	DKK	0	0	0,00
1,000 % éch. 01/10/2050		105 202	9 995	1,64
1,000 % éch. 01/10/2053		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2037		150	17	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
0,250 % éch. 13/01/2026	€	4 900	4 327	0,71
0,375 % éch. 17/01/2028		1 200	969	0,16
0,500 % éch. 01/10/2043	DKK	0	0	0,00
1,000 % éch. 01/10/2050		74 797	7 414	1,22
1,000 % éch. 01/10/2053		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2037		290	34	0,01
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2053		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/10/2036		36	4	0,00
2,500 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
P3 Group SARL				
1,625 % éch. 26/01/2029	€	4 000	2 950	0,48
Pacific Life Global Funding				
1,200 % éch. 24/06/2025	$	200	170	0,03
Prologis International Funding S.A.				
3,125 % éch. 01/06/2031	€	900	802	0,13
QNB Finance Ltd.				
1,375 % éch. 26/01/2026	$	3 300	2 772	0,45
Realkredit Danmark A/S				
2,500 % éch. 01/04/2036	DKK	3	0	0,00
2,500 % éch. 01/04/2047		0	0	0,00
Sagax AB				
1,125 % éch. 30/01/2027	€	1 600	1 296	0,21
Sagax Euro MTN NL BV				
0,750 % éch. 26/01/2028		800	603	0,10
Santander UK Group Holdings PLC				
0,603 % éch. 13/09/2029		9 400	7 325	1,20
2,975 % éch. 27/03/2024		2 000	2 001	0,33
SBB Treasury Oyj				
2,284 % éch. 08/02/2024		1 900	1 768	0,29
SELP Finance SARL				
3,750 % éch. 10/08/2027		400	373	0,06
Sirius Real Estate Ltd.				
1,125 % éch. 22/06/2026		4 800	3 756	0,62
Skandinaviska Enskilda Banken AB				
4,000 % éch. 09/11/2026		2 100	2 109	0,35
Société Générale S.A.				
0,625 % éch. 02/12/2027		2 000	1 722	0,28
1,792 % éch. 09/06/2027	$	4 700	3 794	0,62
Sofina S.A.				
1,000 % éch. 23/09/2028	€	4 900	3 832	0,63
Standard Chartered PLC				
0,800 % éch. 17/11/2029		1 000	796	0,13
1,214 % éch. 23/03/2025 (e)	$	200	177	0,03
1,214 % éch. 23/03/2025		3 800	3 362	0,55
3,785 % éch. 21/05/2025		1 300	1 176	0,19
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
1,474 % éch. 08/07/2025		400	342	0,06
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % éch. 18/11/2028	£	3 300	2 742	0,45
UBS Group AG				
1,250 % éch. 17/04/2025	€	12 500	12 023	1,97
UniCredit SpA				
5,850 % éch. 15/11/2027		1 400	1 423	0,23

Tableau des investissements Fonds Euro Credit Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Vonovia SE					
1,375 % éch. 28/01/2026	€	200	€	182	0,03
4,750 % éch. 23/05/2027		700		693	0,11
WEA Finance LLC					
3,750 % éch. 17/09/2024	$	1 700		1 506	0,25
Wells Fargo & Co.					
1,000 % éch. 02/02/2027	€	12 100		10 635	1,74
WPC Eurobond BV					
1,350 % éch. 15/04/2028		2 100		1 750	0,29
				292 227	47,91
INDUSTRIE					
AA Bond Co. Ltd.					
4,875 % éch. 31/07/2043	£	2 100		2 243	0,37
Abertis Infraestructuras S.A.					
1,625 % éch. 15/07/2029	€	100		82	0,01
Atlantia SpA					
1,625 % éch. 03/02/2025		2 500		2 341	0,38
Chanel Ceres PLC					
0,500 % éch. 31/07/2026		4 100		3 696	0,61
Cie Plastic Omnium S.A.					
1,250 % éch. 26/06/2024		3 000		2 830	0,46
DAE Funding LLC					
1,550 % éch. 01/08/2024	$	1 400		1 220	0,20
1,625 % éch. 15/02/2024		3 200		2 848	0,47
2,625 % éch. 20/03/2025		2 800		2 458	0,40
3,375 % éch. 20/03/2028		900		750	0,12
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide					
1,875 % éch. 31/03/2028	€	800		691	0,11
2,125 % éch. 09/07/2027		7 200		6 464	1,06
GN Store Nord A/S					
0,875 % éch. 25/11/2024		4 600		4 143	0,68
Holding d'Infrastructures de Transport SASU					
1,625 % éch. 18/09/2029		100		82	0,01
IMCD NV					
2,125 % éch. 31/03/2027		100		89	0,01
2,500 % éch. 26/03/2025		1 102		1 071	0,18
Informa PLC					
2,125 % éch. 06/10/2025		100		95	0,02
InterContinental Hotels Group PLC					
2,125 % éch. 15/05/2027		4 600		4 242	0,69
JCDecaux SE					
1,625 % éch. 07/02/2030		200		160	0,03
JDE Peet's NV					
0,500 % éch. 16/01/2029		3 850		3 077	0,50
Las Vegas Sands Corp.					
2,900 % éch. 25/06/2025	$	850		733	0,12
Mitchells & Butlers Finance PLC					
5,219 % éch. 15/12/2030		419		364	0,06
5,965 % éch. 15/12/2025	£	9		10	0,00
6,013 % éch. 15/12/2030		108		114	0,02
Nissan Motor Co. Ltd.					
2,652 % éch. 17/03/2026	€	3 000		2 788	0,46
3,201 % éch. 17/09/2028		1 100		967	0,16
Prosus NV					
1,207 % éch. 19/01/2026		1 000		903	0,15
Rentokil Initial Finance BV					
3,875 % éch. 27/06/2027		900		892	0,15
Rockies Express Pipeline LLC					
3,600 % éch. 15/05/2025	$	100		89	0,01
SEB S.A.					
1,500 % éch. 31/05/2024	€	3 100		2 965	0,49
Silfin NV					
2,875 % éch. 11/04/2027		900		765	0,12
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA					
3,500 % éch. 09/10/2025		2 100		1 953	0,32
Suez SACA					
5,000 % éch. 03/11/2032		1 700		1 745	0,29
Syngenta Finance NV					
3,375 % éch. 16/04/2026		3 100		2 931	0,48
4,441 % éch. 24/04/2023	$	500		466	0,08
4,892 % éch. 24/04/2025		3 751		3 407	0,56
TDF Infrastructure SASU					
1,750 % éch. 01/12/2029	€	3 200		2 436	0,40
TenneT Holding BV					
4,250 % éch. 28/04/2032	€	400	€	409	0,07
Thames Water Utilities Finance PLC					
0,875 % éch. 31/01/2028		1 800		1 535	0,25
Ubisoft Entertainment S.A.					
1,289 % éch. 30/01/2023		3 700		3 691	0,60
Vilmorin & Cie S.A.					
1,375 % éch. 26/03/2028		4 500		3 337	0,55
Worldline S.A.					
1,625 % éch. 13/09/2024		4 800		4 626	0,76
Worley U.S. Finance Sub Ltd.					
0,875 % éch. 09/06/2026		4 200		3 661	0,60
				79 369	13,01
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS					
EnBW International Finance BV					
4,049 % éch. 22/11/2029		200		199	0,03
Enel Finance International NV					
4,250 % éch. 15/06/2025	$	800		727	0,12
Galp Energia SGPS S.A.					
2,000 % éch. 15/01/2026	€	2 000		1 842	0,30
Global Switch Holdings Ltd.					
1,500 % éch. 31/01/2024		4 600		4 471	0,73
National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC					
3,530 % éch. 20/09/2028		300		293	0,05
TDC Net A/S					
5,056 % éch. 31/05/2028		1 700		1 675	0,28
				9 207	1,51
Total des Obligations et billets privés				380 803	62,43
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN					
Ginnie Mae, TBA					
4,500 % éch. 01/01/2053	$	4 000		3 637	0,60
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA					
3,000 % éch. 01/02/2053		1 300		1 070	0,17
5,000 % éch. 01/01/2053		8 200		7 572	1,24
				12 279	2,01
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX					
Canada Square Funding PLC					
4,375 % éch. 17/06/2058	£	1 127		1 246	0,20
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust					
4,084 % éch. 25/08/2034 ^	$	23		19	0,00
Domi BV					
2,676 % éch. 15/06/2053	€	983		969	0,16
Dutch Property Finance BV					
2,228 % éch. 28/07/2058		2 264		2 235	0,37
2,328 % éch. 28/10/2059		3 474		3 423	0,56
Great Hall Mortgages PLC					
4,868 % éch. 18/06/2039	$	222		204	0,03
Jubilee Place BV					
2,228 % éch. 17/01/2059	€	2 257		2 217	0,36
2,378 % éch. 17/10/2057		493		489	0,08
Landmark Mortgage Securities PLC					
3,668 % éch. 17/04/2044	£	869		919	0,15
Miravet SARL					
2,758 % éch. 26/05/2065	€	2 008		1 942	0,32
Newgate Funding PLC					
2,646 % éch. 15/12/2050		186		173	0,03
Primrose Residential DAC					
2,894 % éch. 24/10/2061		2 594		2 528	0,42
RMAC Securities PLC					
3,656 % éch. 12/06/2044	£	91		95	0,02
Southern Pacific Financing PLC					
3,956 % éch. 10/03/2044		6		6	0,00
Stratton Mortgage Funding PLC					
3,826 % éch. 20/07/2060		3 975		4 442	0,73
Structured Asset Mortgage Investments Trust					
5,039 % éch. 19/12/2034	$	65		54	0,01
Towd Point Mortgage Funding PLC					
4,071 % éch. 20/10/2051	£	1 426		1 598	0,26
Twin Bridges PLC					
4,237 % éch. 12/03/2055		2 276		2 510	0,41
				25 069	4,11
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS					
Ares European CLO DAC					
1,988 % éch. 15/04/2030	€	494	€	481	0,08
Aurium CLO DAC					
3,152 % éch. 23/03/2032		1 300		1 273	0,21
Bastille Euro CLO DAC					
2,528 % éch. 15/01/2034		2 700		2 606	0,43
Black Diamond CLO DAC					
2,834 % éch. 03/10/2029		31		31	0,01
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC					
2,028 % éch. 15/07/2030		391		382	0,06
Bosphorus CLO DAC					
3,000 % éch. 12/12/2032		1 900		1 844	0,30
Cairn CLO DAC					
2,253 % éch. 25/04/2032		600		585	0,10
2,333 % éch. 25/07/2029		1 004		996	0,16
Carlyle Euro CLO DAC					
2,428 % éch. 15/08/2030		697		680	0,11
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC					
2,128 % éch. 15/07/2030		4 890		4 762	0,78
2,338 % éch. 16/01/2033		1 600		1 541	0,25
Contego CLO BV					
2,148 % éch. 15/10/2030		700		684	0,11
CVC Cordatus Loan Fund DAC					
2,578 % éch. 15/08/2032		1 000		975	0,16
2,962 % éch. 17/06/2032		900		866	0,14
Dryden Euro CLO DAC					
2,228 % éch. 15/07/2031		830		811	0,13
2,622 % éch. 15/05/2034		200		194	0,03
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC					
2,356 % éch. 20/01/2032		100		97	0,02
Grosvenor Place CLO BV					
2,325 % éch. 30/10/2029		964		954	0,16
Harvest CLO DAC					
1,100 % éch. 18/11/2029		35		35	0,01
2,228 % éch. 15/01/2032		200		194	0,03
2,433 % éch. 18/11/2029		225		222	0,04
Invesco Euro CLO DAC					
2,028 % éch. 15/07/2031		500		486	0,08
Jubilee CLO DAC					
1,978 % éch. 15/04/2030		1 000		978	0,16
2,846 % éch. 15/12/2029		1 121		1 100	0,18
Madison Park Euro Funding DAC					
2,178 % éch. 15/07/2032		600		581	0,09
Man GLG Euro CLO DAC					
2,188 % éch. 15/10/2032		2 798		2 707	0,44
OCP Euro CLO DAC					
2,198 % éch. 15/01/2032		366		359	0,06
Palmer Square European Loan Funding DAC					
2,098 % éch. 15/10/2031		2 689		2 608	0,43
2,428 % éch. 15/10/2031		874		853	0,14
Renaissance Home Equity Loan Trust					
5,340 % éch. 25/01/2037	$	1 291		398	0,07
Segovia European CLO DAC					
2,336 % éch. 20/07/2032	€	500		484	0,08
Toro European CLO DAC					
2,239 % éch. 12/01/2032		200		193	0,03
2,572 % éch. 15/02/2034		500		482	0,08
Voya Euro CLO DAC					
2,128 % éch. 15/10/2030		200		196	0,03
				31 638	5,19
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Caisse Française de Financement Local					
3,125 % éch. 16/11/2027		200		198	0,03
INSTRUMENTS À COURT TERME					
BONS DU TRÉSOR BELGE					
1,641 % éch. 09/03/2023 (a)(b)		1 300		1 296	0,21
1,643 % éch. 09/03/2023 (a)(b)		1 300		1 296	0,21
				2 592	0,42
BONS DU TRÉSOR DE L'UNION EUROPÉENNE					
1,369 % éch. 03/03/2023 (a)(b)		2 000		1 994	0,32

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
1,764 % éch. 03/03/2023 (a)(b)	€ 2 000	€ 1 994	0,33
		3 988	0,65
BONS DU TRÉSOR DU MÉCANISME EUROPÉEN DE STABILISATION			
1,754 % éch. 09/03/2023 (a)(b)	800	797	0,13
1,755 % éch. 09/03/2023 (a)(b)	1 000	997	0,17
1,760 % éch. 09/03/2023 (a)(b)	1 000	997	0,16
		2 791	0,46
BONS DU TRÉSOR FRANÇAIS			
0,253 % éch. 04/01/2023 (a)(b)	5 400	5 400	0,89
0,994 % éch. 22/02/2023 (a)(b)	2 800	2 794	0,46
1,600 % éch. 22/03/2023 (a)(b)	700	698	0,12
1,612 % éch. 22/03/2023 (a)(b)	700	698	0,11
1,625 % éch. 22/03/2023 (a)(b)	700	697	0,11
		10 287	1,69
BONS DU TRÉSOR ALLEMAND			
0,958 % éch. 18/01/2023 (a)(b)(f)	9 220	9 217	1,51
1,939 % éch. 17/05/2023 (a)(b)	2 750	2 730	0,45
		11 947	1,96

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
BONS DU TRÉSOR ESPAGNOL			
1,447 % éch. 13/01/2023 (a)(b)	€ 430	€ 430	0,07
1,448 % éch. 13/01/2023 (a)(b)	290	290	0,05
1,455 % éch. 13/01/2023 (a)(b)	580	579	0,09
1,460 % éch. 13/01/2023 (a)(b)	500	500	0,08
		1 799	0,29
Total des Instruments à court terme		33 404	5,47
Total des Valeurs mobilières		**€ 491 678**	**80,60**
	ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT			
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (d)	532 500	50 689	8,31
Total des Fonds d'investissement		**€ 50 689**	**8,31**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BPS	(1,000) %	30/12/2022	02/01/2023	€ 7 400	Landwirtschaftliche Rentenbank 0,500 % échéance 28/02/2029	€ (7 498)	€ 7 400	€ 7 399	1,21
FICC	1,900	30/12/2022	03/01/2023	$ 983	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 29/06/2023	(940)	921	921	0,15
IND	(0,500)	30/12/2022	02/01/2023	€ 36 300	BNG Bank NV 0,000 % - 0,500 % échéance 16/04/2025 - 31/08/2028	(2 776)	36 300	36 298	5,95
					Bpifrance SACA 0,250 % échéance 29/03/2030	(483)			
					Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale, 2,750 %, échéance 25/11/2032	(568)			
					Banque de développement du Conseil de l'Europe 0,000 % échéance 20/01/2031	(784)			
					Fonds européen de stabilité financière 0,000 % - 3,000 % échéance 15/10/2025 - 04/09/2034	(4 447)			
					Banque européenne d'investissement 0,000 % - 4,000 % échéance 15/03/2024 - 14/03/2042	(6 798)			
					Bons du Trésor du Mécanisme européen de stabilisation 1,800 % échéance 02/11/2046	(549)			
					Union européenne 0,000 % - 3,375 % échéance 04/11/2025 - 04/03/2053	(12 520)			
					Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % - 1,375 % échéance 07/11/2023 - 29/09/2034	(4 431)			
					Land de Rhénanie-du-Nord-Westphalie 2,375 % échéance 13/05/2033	(837)			
					Landwirtschaftliche Rentenbank 0,375 % - 0,500 % échéance 14/02/2028 – 28/02/2029	(1 038)			
					UNEDIC 1,500 % échéance 20/04/2032	(1 626)			
Total des Contrats de mise en pension						**€ (45 295)**	**€ 44 621**	**€ 44 618**	**7,31**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	72	€ 456	0,08
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	Long	03/2023	131	(3 348)	(0,55)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Court	03/2023	16	5	0,00
				€ (2 887)	(0,47)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**€ (2 887)**	**(0,47)**

Tableau des investissements Fonds Euro Credit Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AT&T, Inc.	1,000 %	20/06/2024	$ 5 600	€ (78)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	6 300	(96)	(0,02)
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2025	€ 2 500	(46)	(0,01)
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2027	1 100	(34)	(0,01)
British Telecommunications PLC	1,000	20/06/2028	3 300	(106)	(0,02)
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2028	1 600	(42)	(0,01)
Électricité de France S.A.	1,000	20/12/2026	3 300	(65)	(0,01)
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2027	$ 700	1	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	2 900	(3)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2026	400	(2)	0,00
General Motors Co.	5,000	20/06/2026	500	(33)	(0,01)
LafargeHolcim Ltd.	1,000	20/06/2026	€ 5 800	(90)	(0,01)
Marks & Spencer PLC	1,000	20/12/2024	1 500	(4)	0,00
Stellantis NV	5,000	20/06/2026	5 900	(455)	(0,07)
Syngenta Finance NV	1,000	20/06/2028	400	(9)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20/06/2028	100	(2)	0,00
Tesco PLC	1,000	20/12/2027	4 700	(94)	(0,01)
				€ (1 158)	(0,19)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice iTraxx Europe Main 37 à 5 ans	1,000 %	20/06/2027	€ 49 600	€ 122	0,02

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250 %	15/03/2028	£ 8 700	€ 252	0,04
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,050	15/12/2031	¥ 1 860 000	456	0,08
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024	$ 23 000	87	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2052	3 400	316	0,05
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,500	16/06/2026	27 600	2 642	0,43
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,750	16/06/2031	15 100	2 202	0,36
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2025	€ 21 200	(225)	(0,04)
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028	105 600	(3 326)	(0,54)
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	133 800	(3 193)	(0,52)
					€ (789)	(0,13)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**€ (1 825)**	**(0,30)**

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

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

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

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

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

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente - Indice iTraxx Europe 37 à 5 ans hors cote	Vente	3,000 %	15/03/2023	1 800	€ (3)	€ 0	0,00

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,500 %	07/02/2023	52 200	€ (151)	€ (1 458)	(0,24)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
MYC	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000 %	20/12/2026	$ 200	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2027	400	(14)	9	(5)	0,00
					€ (14)	€ 9	€ (5)	0,00

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

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

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€ 2 981	$ 3 150	€ 0	€ (31)	€ (31)	(0,01)
	02/2023	£ 144	€ 162	1	0	1	0,00
	02/2023	¥ 164 900	1 145	0	(30)	(30)	0,00
BPS	03/2023	$ 2 189	MXN 44 118	40	0	40	0,01
BRC	01/2023	€ 23 854	$ 25 448	0	(19)	(19)	0,00
	01/2023	$ 1 062	€ 1 010	15	0	15	0,00
	02/2023	€ 866	¥ 124 400	19	0	19	0,00
CBK	01/2023	DKK 191 616	€ 25 772	3	0	3	0,00
	01/2023	€ 458	DKK 3 405	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 8	BRL 42	0	0	0	0,00
	02/2023	€ 829	£ 732	0	(5)	(5)	0,00
	03/2023	$ 235	MXN 4 602	0	(2)	(2)	0,00
GLM	01/2023	BRL 42	$ 8	0	0	0	0,00
	02/2023	$ 8	BRL 42	0	0	0	0,00
	03/2023	MXN 47 752	$ 2 323	0	(87)	(87)	(0,01)
JPM	01/2023	CNH 53	8	0	0	0	0,00
	02/2023	€ 1 044	¥ 150 200	26	0	26	0,00
MBC	01/2023	DKK 10 855	€ 1 460	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 118 059	112 645	2 073	0	2 073	0,34
	02/2023	AUD 14	9	0	0	0	0,00
	05/2023	CNH 7 698	$ 1 147	22	0	22	0,00
MYI	01/2023	€ 6 028	DKK 44 840	2	0	2	0,00
	01/2023	3 726	$ 3 902	0	(71)	(71)	(0,01)
	02/2023	2 305	£ 1 988	0	(68)	(68)	(0,01)
	02/2023	¥ 31 082	€ 216	0	(5)	(5)	0,00
	02/2023	$ 42	ZAR 773	3	0	3	0,00
RBC	02/2023	£ 120	€ 137	2	0	2	0,00
	02/2023	¥ 177 500	1 231	0	(32)	(32)	(0,01)
SCX	02/2023	€ 1 202	¥ 173 800	35	0	35	0,01
	02/2023	¥ 113 400	€ 791	0	(17)	(17)	0,00
SSB	02/2023	£ 20 482	23 337	292	0	292	0,05
UAG	05/2023	$ 1 052	CNH 7 293	11	0	11	0,00
				€ 2 544	€ (367)	€ 2 177	0,36

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**€ 714**	**0,12**
Total des Investissements	**€ 582 990**	**95,57**
Autres actifs et passifs à court terme	**€ 27 018**	**4,43**
Actif net	**€ 610 008**	**100,00**

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

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

^ **Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.**

(a) **Titre à coupon zéro.**

(b) **Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.**

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

(d) **Affilié au Fonds.**

Tableau des investissements Fonds Euro Credit Fund (suite)

(e) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,07 %) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Deutsche Bank AG	2,129 %	24/11/2026	17/11/2020	€ 337	€ 331	0,05
Standard Chartered PLC	1,214	23/03/2025	16/03/2021	168	177	0,03
				€ 505	€ 508	0,08

(f) Des titres d'une juste valeur globale de 262 € (31 décembre 2021 : 0 €) et un montant en numéraire de 1 150 € (31 décembre 2021 : 10 €) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Un montant en numéraire de 25 216 € (31 décembre 2021 : 34 510 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	€ 0	€ 491 678	€ 0	€ 491 678
Fonds d'investissement	50 689	0	0	50 689
Contrats de mise en pension	0	44 621	0	44 621
Instruments financiers dérivés[3]	(2 892)	(1 106)	0	(3 998)
Totaux	**€ 47 797**	**€ 535 193**	**€ 0**	**€ 582 990**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	€ 0	€ 902 376	€ 0	€ 902 376
Fonds d'investissement	0	63 657	0	63 657
Contrats de mise en pension	0	5 883	0	5 883
Instruments financiers dérivés[3]	(1 606)	654	(15)	(967)
Totaux	**€ (1 606)**	**€ 972 570**	**€ (15)**	**€ 970 949**

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

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

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	€ (60)	€ 0	€ (60)	€ (15)	€ 0	€ (15)
BPS	40	0	40	2	0	2
BRC	15	0	15	(16)	0	(16)
CBK	(4)	0	(4)	(1)	0	(1)
DUB	S/O	S/O	S/O	15	0	15
FBF	S/O	S/O	S/O	(15)	0	(15)
GLM	(1 545)	1 412	(133)	(379)	0	(379)
GST	S/O	S/O	S/O	(9)	10	1
HUS	S/O	S/O	S/O	(36)	0	(36)
JPM	26	0	26	814	(890)	(76)
MBC	2 095	(1 900)	195	S/O	S/O	S/O
MYC	(5)	0	(5)	(2)	0	(2)
MYI	(139)	(50)	(189)	S/O	S/O	S/O
RBC	(30)	0	(30)	15	0	15
RYL	S/O	S/O	S/O	76	0	76
SCX	18	0	18	1 434	(1 140)	294
SSB	292	0	292	S/O	S/O	S/O
UAG	11	0	11	S/O	S/O	S/O

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	72,82	84,44
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	7,71	3,43
Autres valeurs mobilières	0,07	0,84
Fonds d'investissement	8,31	6,26
Contrats de mise en pension	7,31	0,58
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,47)	(0,16)
Instruments financiers dérivés compensés	(0,30)	(0,12)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,12	0,19

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Crédits consortiaux et cessions	1,36	1,54
Obligations et billets privés	62,43	79,65
Agences du gouvernement américain	2,01	S/O
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	4,11	2,58
Titres adossés à des actifs	5,19	3,76
Émissions souveraines	0,03	1,01
Instruments à court terme	5,47	0,17
Fonds d'investissement	8,31	6,26
Contrats de mise en pension	7,31	0,58
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,47)	(0,16)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,19)	(0,03)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,02	0,01
Swaps de taux d'intérêt	(0,13)	(0,10)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,24)	S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,08
Contrats de change à terme	0,36	0,11
Autres actifs et passifs à court terme	4,43	4,54
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Euro Income Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES					
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS					
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC					
6,603 % éch. 01/12/2027	$	5 684	€	5 323	0,39
Casino Guichard-Perrachon S.A.					
5,340 % éch. 31/08/2025	€	4 900		4 169	0,31
Charter Communications Operating LLC					
6,140 % éch. 01/02/2027	$	2 735		2 506	0,19
Envision Healthcare Corp.					
12,119 % éch. 29/04/2027		3 724		3 415	0,25
Grifols S.A.					
3,708 % éch. 15/11/2027	€	6 000		5 815	0,43
Hilton Domestic Operating Co., Inc.					
6,173 % éch. 22/06/2026	$	3 798		3 552	0,26
INEOS Finance PLC					
4,648 % éch. 08/11/2028	€	5 000		4 719	0,35
Sigma Bidco BV					
3,738 % éch. 02/07/2025		1 300		1 133	0,08
				30 632	2,26
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
BANQUE ET FINANCE					
ABH Financial Ltd. Via Alfa Holding Issuance PLC					
2,700 % éch. 11/06/2023		8 200		574	0,04
ABN AMRO Bank NV					
2,470 % éch. 13/12/2029	$	1 300		987	0,07
ADLER Real Estate AG					
3,000 % éch. 27/04/2026	€	600		419	0,03
AerCap Ireland Capital DAC					
3,150 % éch. 15/02/2024	$	7 300		6 615	0,49
Aircastle Ltd.					
4,250 % éch. 15/06/2026		300		265	0,02
Altarea S.C.A.					
1,750 % éch. 16/01/2030	€	1 500		1 119	0,08
1,875 % éch. 17/01/2028		6 000		4 669	0,35
Aroundtown S.A.					
0,375 % éch. 15/04/2027		1 900		1 260	0,09
1,450 % éch. 09/07/2028		700		438	0,03
1,500 % éch. 28/05/2026		11 000		8 448	0,62
5,375 % éch. 21/03/2029	$	3 600		2 557	0,19
Atrium Finance PLC					
2,625 % éch. 05/09/2027	€	2 200		1 542	0,11
Avolon Holdings Funding Ltd.					
2,528 % éch. 18/11/2027	$	172		129	0,01
2,875 % éch. 15/02/2025		13 700		11 868	0,88
4,250 % éch. 15/04/2026		300		255	0,02
Balder Finland Oyj					
1,000 % éch. 20/01/2029	€	800		536	0,04
2,000 % éch. 18/01/2031		6 500		4 186	0,31
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA					
3,625 % éch. 24/09/2024		8 500		8 089	0,60
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.					
6,138 % éch. 14/09/2028	$	1 100		1 034	0,08
Banco de Sabadell S.A.					
1,125 % éch. 27/03/2025	€	14 000		12 826	0,95
Bank of Ireland Group PLC					
1,875 % éch. 05/06/2026		3 600		3 346	0,25
Barclays PLC					
7,437 % éch. 02/11/2033	$	11 850		11 668	0,86
BNP Paribas S.A.					
1,323 % éch. 13/01/2027		500		410	0,03
1,904 % éch. 30/09/2028		2 300		1 798	0,13
4,400 % éch. 14/08/2028		700		621	0,05
BPCE S.A.					
0,500 % éch. 14/01/2028	€	1 200		1 027	0,08
2,375 % éch. 14/01/2025	$	100		87	0,01
Castellum Helsinki Finance Holding Abp					
0,875 % éch. 17/09/2029	€	4 700		3 071	0,23
2,000 % éch. 24/03/2025		5 500		4 886	0,36
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund					
0,500 % éch. 27/01/2028		1 200		930	0,07
CIMIC Finance Ltd.					
1,500 % éch. 28/05/2029		5 000		3 773	0,28
Citycon Treasury BV					
1,625 % éch. 12/03/2028	€	10 600	€	7 758	0,57
Corestate Capital Holding S.A.					
3,500 % éch. 15/04/2023 ^		11 600		1 816	0,13
Country Garden Holdings Co. Ltd.					
2,700 % éch. 12/07/2026	$	2 600		1 395	0,10
3,125 % éch. 22/10/2025		1 500		862	0,06
CPI Property Group S.A.					
1,625 % éch. 23/04/2027	€	9 300		6 644	0,49
2,750 % éch. 12/05/2026		100		79	0,01
Credit Suisse AG					
6,500 % éch. 08/08/2023 (f)	$	11 200		10 187	0,75
Credit Suisse Group AG					
1,250 % éch. 17/07/2025	€	7 000		6 293	0,46
3,750 % éch. 26/03/2025	$	1 550		1 308	0,10
Cromwell Ereit Lux Finco SARL					
2,125 % éch. 19/11/2025	€	10 000		8 086	0,60
CTP NV					
0,625 % éch. 27/09/2026		1 600		1 233	0,09
1,250 % éch. 21/06/2029		7 000		4 667	0,34
1,500 % éch. 27/09/2031		1 500		902	0,07
Deutsche Bank AG					
1,375 % éch. 17/02/2032		700		511	0,04
1,625 % éch. 20/01/2027		14 200		12 542	0,93
1,750 % éch. 17/01/2028		4 600		3 939	0,29
1,750 % éch. 19/11/2030		6 200		4 883	0,36
2,552 % éch. 07/01/2028	$	3 600		2 872	0,21
3,035 % éch. 28/05/2032 (g)		200		142	0,01
3,547 % éch. 18/09/2031		1 100		829	0,06
Digital Euro Finco LLC					
1,125 % éch. 09/04/2028	€	1 300		1 055	0,08
Digital Intrepid Holding BV					
0,625 % éch. 15/07/2031		800		551	0,04
1,375 % éch. 18/07/2032		7 500		5 364	0,40
DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH					
2,500 % éch. 25/01/2027		6 400		4 798	0,35
EQT AB					
2,375 % éch. 06/04/2028		1 300		1 145	0,08
Fairfax Financial Holdings Ltd.					
2,750 % éch. 29/03/2028		21 600		18 903	1,40
Ford Motor Credit Co. LLC					
1,744 % éch. 19/07/2024		100		96	0,01
2,330 % éch. 25/11/2025		400		369	0,03
2,684 % éch. 01/12/2024		3 100		2 997	0,22
G City Europe Ltd.					
4,250 % éch. 11/09/2025		6 400		5 375	0,40
Globalworth Real Estate Investments Ltd.					
3,000 % éch. 29/03/2025		6 600		5 792	0,43
HSBC Holdings PLC					
1,589 % éch. 24/05/2027	$	17 500		14 157	1,05
2,099 % éch. 04/06/2026		600		512	0,04
3,973 % éch. 22/05/2030		1 800		1 480	0,11
Intesa Sanpaolo SpA					
5,017 % éch. 26/06/2024		4 500		4 056	0,30
8,248 % éch. 21/11/2033		9 025		8 603	0,64
Jyske Realkredit A/S					
0,500 % éch. 01/10/2043	DKK	0		0	0,00
1,000 % éch. 01/10/2050		0		0	0,00
1,000 % éch. 01/10/2053		0		0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2037		0		0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		0		0	0,00
Kaisa Group Holdings Ltd.					
10,875 % éch. 23/07/2023 ^	$	5 400		712	0,05
11,500 % éch. 30/01/2023 ^		3 500		462	0,03
11,650 % éch. 01/06/2026 ^		4 000		528	0,04
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.					
3,250 % éch. 12/11/2025	€	5 800		4 560	0,34
Lincoln Financing SARL					
3,625 % éch. 01/04/2024		14 300		14 160	1,05
Lloyds Banking Group PLC					
4,716 % éch. 11/08/2026	$	1 600		1 468	0,11
Logicor Financing SARL					
1,500 % éch. 13/07/2026	€	2 600		2 202	0,16
1,625 % éch. 17/01/2030		3 600		2 632	0,19
MPT Operating Partnership LP					
0,993 % éch. 15/10/2026		1 300		995	0,07
2,500 % éch. 24/03/2026	£	1 800	€	1 616	0,12
3,375 % éch. 24/04/2030		1 300		961	0,07
NE Property BV					
1,750 % éch. 23/11/2024	€	2 600		2 434	0,18
1,875 % éch. 09/10/2026		2 900		2 444	0,18
2,000 % éch. 20/01/2030		1 700		1 180	0,09
3,375 % éch. 14/07/2027		2 000		1 736	0,13
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab					
0,500 % éch. 01/10/2043	DKK	0		0	0,00
1,000 % éch. 01/10/2050		75 238		7 040	0,52
1,000 % éch. 01/10/2053		0		0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		0		0	0,00
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.					
1,875 % éch. 27/01/2025	€	2 500		2 268	0,17
Nova Ljubljanska Banka d.d.					
3,400 % éch. 05/02/2030		1 000		830	0,06
3,650 % éch. 19/11/2029		2 000		1 680	0,12
Nykredit Realkredit A/S					
0,500 % éch. 01/10/2043	DKK	0		0	0,00
1,000 % éch. 01/10/2050		113 180		11 218	0,83
1,000 % éch. 01/10/2053		170 096		16 717	1,24
1,500 % éch. 01/10/2037		348		41	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		0		0	0,00
2,500 % éch. 01/10/2036		9		1	0,00
Peugeot Invest					
1,875 % éch. 30/10/2026	€	3 200		2 631	0,19
Prologis International Funding S.A.					
3,125 % éch. 01/06/2031		1 600		1 425	0,11
Realkredit Danmark A/S					
2,500 % éch. 01/04/2036	DKK	11		1	0,00
Sagax AB					
1,125 % éch. 30/01/2027	€	7 082		5 736	0,42
2,000 % éch. 17/01/2024		1 400		1 343	0,10
2,250 % éch. 13/03/2025		5 100		4 712	0,35
Sagax Euro MTN NL BV					
0,750 % éch. 26/01/2028		1 400		1 055	0,08
1,000 % éch. 17/05/2029		1 700		1 197	0,09
Santander UK Group Holdings PLC					
0,603 % éch. 13/09/2029		7 500		5 845	0,43
2,896 % éch. 15/03/2032	$	13 185		9 574	0,71
SELP Finance SARL					
3,750 % éch. 10/08/2027	€	1 700		1 584	0,12
Sirius Real Estate Ltd.					
1,125 % éch. 22/06/2026		3 700		2 895	0,21
1,750 % éch. 24/11/2028		3 500		2 408	0,18
Société Générale S.A.					
2,226 % éch. 21/01/2026	$	11 000		9 487	0,70
2,797 % éch. 19/01/2028		10 800		8 867	0,66
Sofina S.A.					
1,000 % éch. 23/09/2028	€	7 400		5 787	0,43
Standard Chartered PLC					
1,822 % éch. 23/11/2025	$	1 100		942	0,07
Sunac China Holdings Ltd.					
5,950 % éch. 26/04/2024 ^		2 200		452	0,03
6,500 % éch. 26/01/2026 ^		4 200		817	0,06
TP ICAP Finance PLC					
2,625 % éch. 18/11/2028	£	8 600		7 145	0,53
UniCredit SpA					
1,982 % éch. 03/06/2027	$	500		400	0,03
2,200 % éch. 22/07/2027	€	1 400		1 270	0,09
3,127 % éch. 03/06/2032	$	6 000		4 238	0,31
Vonovia SE					
4,750 % éch. 23/05/2027	€	800		792	0,06
WPC Eurobond BV					
1,350 % éch. 15/04/2028		7 000		5 834	0,43
Yango Justice International Ltd.					
7,875 % éch. 04/09/2024 ^	$	12 600		431	0,03
				416 387	30,78
INDUSTRIE					
AA Bond Co. Ltd.					
4,875 % éch. 31/07/2043	£	2 400		2 564	0,19
5,500 % éch. 31/07/2050		4 510		4 410	0,33
Accor S.A.					
2,375 % éch. 29/11/2028	€	9 600		8 235	0,61
Altice Financing S.A.					
3,000 % éch. 15/01/2028		2 200		1 744	0,13

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,250 % éch. 15/08/2029	€	300	€ 244	0,02
5,750 % éch. 15/08/2029	$	6 000	4 433	0,33
Altice France S.A.				
3,375 % éch. 15/01/2028	€	5 000	3 785	0,28
Atlantia SpA				
1,875 % éch. 13/07/2027		1 500	1 278	0,09
1,875 % éch. 12/02/2028		11 500	9 588	0,71
Chanel Ceres PLC				
1,000 % éch. 31/07/2031		1 700	1 313	0,10
DAE Funding LLC				
3,375 % éch. 20/03/2028	$	2 600	2 166	0,16
Fortune Star BVI Ltd.				
3,950 % éch. 02/10/2026	€	15 100	8 681	0,64
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide				
2,125 % éch. 09/07/2027		10 500	9 426	0,70
GN Store Nord A/S				
0,875 % éch. 25/11/2024		4 500	4 053	0,30
IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % en numéraire ou 4,375 % de rémunération en nature)				
3,625 % éch. 15/05/2025 (b)		10 200	9 333	0,69
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % en numéraire ou 4,500 % de rémunération en nature)				
3,750 % éch. 15/09/2026 (b)		4 500	3 925	0,29
IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % en numéraire ou 4,625 % de rémunération en nature)				
3,875 % éch. 15/05/2027 (b)		4 300	3 649	0,27
IMCD NV				
2,500 % éch. 26/03/2025		1 560	1 515	0,11
INEOS Finance PLC				
2,875 % éch. 01/05/2026		1 800	1 557	0,12
Las Vegas Sands Corp.				
2,900 % éch. 25/06/2025	$	1 600	1 379	0,10
Loxam S.A.S.				
3,250 % éch. 14/01/2025	€	14 600	13 953	1,03
Mitchells & Butlers Finance PLC				
3,972 % éch. 15/12/2030	£	461	470	0,04
5,219 % éch. 15/12/2030	$	797	692	0,05
Nissan Motor Co. Ltd.				
2,652 % éch. 17/03/2026	€	11 400	10 594	0,78
3,201 % éch. 17/09/2028		900	791	0,06
4,345 % éch. 17/09/2027	$	1 200	1 021	0,08
Pinnacle Bidco PLC				
5,500 % éch. 15/02/2025	€	200	176	0,01
6,375 % éch. 15/02/2025	£	800	786	0,06
Q-Park Holding BV				
3,500 % éch. 01/02/2025	€	7 800	7 077	0,52
Renault S.A.				
2,375 % éch. 25/05/2026		800	722	0,05
Roadster Finance DAC				
1,625 % éch. 09/12/2029		200	181	0,01
2,375 % éch. 08/12/2032		400	300	0,02
Sands China Ltd.				
2,800 % éch. 08/03/2027	$	1 000	804	0,06
4,300 % éch. 08/01/2026		2 900	2 511	0,19
5,625 % éch. 08/08/2025		1 700	1 525	0,11
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA				
3,500 % éch. 09/10/2025	€	14 000	13 022	0,96
Standard Industries, Inc.				
2,250 % éch. 21/11/2026		2 200	1 891	0,14
Syngenta Finance NV				
3,375 % éch. 16/04/2026		13 600	12 858	0,95
4,892 % éch. 24/04/2025	$	6 564	5 962	0,44
TDF Infrastructure SASU				
1,750 % éch. 01/12/2029	€	5 200	3 958	0,29
Ubisoft Entertainment S.A.				
0,878 % éch. 24/11/2027		8 600	6 673	0,49
UCB S.A.				
1,000 % éch. 30/03/2028		1 900	1 514	0,11
Verallia S.A.				
1,875 % éch. 10/11/2031		3 600	2 817	0,21
Virgin Media Secured Finance PLC				
4,125 % éch. 15/08/2030	£	1 000	865	0,06
			174 441	12,89
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
Global Switch Holdings Ltd.				
1,500 % éch. 31/01/2024	€	1 500	1 458	0,11
Total des Obligations et billets privés			592 286	43,78

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES				
Corestate Capital Holding S.A.				
1,375 % éch. 28/11/2049 ^	€	7 800	€ 1 453	0,11
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				
3,000 % éch. 01/02/2053	$	25 200	20 746	1,54
5,000 % éch. 01/02/2053		51 000	47 088	3,48
5,500 % éch. 01/02/2053		25 400	23 853	1,76
			91 687	6,78
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
American Home Mortgage Assets Trust				
2,968 % éch. 25/11/2046		448	134	0,01
Atlas Funding PLC				
3,894 % éch. 25/07/2058	£	735	823	0,06
Banc of America Alternative Loan Trust				
2,251 % éch. 25/06/2037 ^(a)	$	245	21	0,00
4,749 % éch. 25/06/2037		226	158	0,01
5,500 % éch. 25/10/2033		194	172	0,01
6,000 % éch. 25/07/2046 ^		229	180	0,01
Banc of America Funding Trust				
3,426 % éch. 20/04/2035 ^		64	51	0,00
3,571 % éch. 20/09/2046 ^		39	32	0,00
4,245 % éch. 20/11/2035 ^		74	61	0,01
4,286 % éch. 20/09/2046 ^		26	23	0,00
4,733 % éch. 20/10/2036		73	51	0,00
4,809 % éch. 25/04/2037 ^		64	53	0,00
6,000 % éch. 25/08/2037 ^		254	184	0,01
Banc of America Mortgage Trust				
6,000 % éch. 25/10/2036 ^		9	7	0,00
BCAP LLC Trust				
3,223 % éch. 26/03/2037		59	44	0,00
3,758 % éch. 27/03/2037		229	175	0,01
5,500 % éch. 25/11/2034 ^		13	10	0,00
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,263 % éch. 25/02/2035		6	5	0,00
4,393 % éch. 25/08/2035		5	4	0,00
6,662 % éch. 25/12/2046 ^		200	151	0,01
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,341 % éch. 25/05/2036 ^		358	194	0,02
3,587 % éch. 25/09/2035 ^		150	59	0,01
3,668 % éch. 25/11/2036 ^		68	29	0,00
4,533 % éch. 25/07/2035 ^		333	228	0,02
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
5,750 % éch. 25/11/2034 ^		177	140	0,01
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				
7,500 % éch. 25/08/2036		4	4	0,00
BX Trust				
6,088 % éch. 15/05/2030		1 015	903	0,07
7,593 % éch. 15/07/2034		1 778	1 641	0,12
Chase Mortgage Finance Trust				
3,162 % éch. 25/03/2037 ^		23	20	0,00
3,499 % éch. 25/01/2036 ^		210	167	0,01
6,000 % éch. 25/05/2037 ^		98	48	0,00
ChaseFlex Trust				
5,000 % éch. 25/07/2037 ^		71	24	0,00
ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
4,112 % éch. 25/08/2037 ^		23	18	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust				
3,223 % éch. 25/03/2037 ^		41	32	0,00
3,993 % éch. 25/04/2037 ^		172	135	0,01
5,500 % éch. 25/12/2035		109	56	0,01
6,250 % éch. 25/11/2037		139	61	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
4,719 % éch. 25/12/2034		5	4	0,00
CitiMortgage Alternative Loan Trust				
6,000 % éch. 25/01/2037 ^		226	187	0,01
6,000 % éch. 25/06/2037 ^		381	305	0,02
Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust				
4,205 % éch. 25/08/2037 ^		56	28	0,00
6,000 % éch. 25/08/2037 ^		50	24	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust				
3,317 % éch. 25/05/2036		11	8	0,00
3,594 % éch. 25/06/2037 ^		53	42	0,00
3,756 % éch. 25/09/2034		4	4	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
5,500 % éch. 25/11/2035	$	77	€ 46	0,00
5,500 % éch. 25/12/2035 ^		62	33	0,00
5,500 % éch. 25/02/2036 ^		49	29	0,00
5,750 % éch. 25/04/2047 ^		99	53	0,00
6,000 % éch. 25/03/2036 ^		206	91	0,01
6,000 % éch. 25/05/2036 ^		156	86	0,01
6,000 % éch. 25/08/2036 ^		32	18	0,00
6,000 % éch. 25/08/2036 ^		165	95	0,01
6,000 % éch. 25/04/2037 ^		60	33	0,00
6,000 % éch. 25/05/2037 ^		778	357	0,03
6,000 % éch. 25/08/2037 ^		315	155	0,01
6,250 % éch. 25/07/2036 ^		1 375	648	0,05
6,250 % éch. 25/12/2036 ^		20	9	0,00
6,500 % éch. 25/12/2036 ^		62	28	0,00
6,500 % éch. 25/08/2037 ^		340	140	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,869 % éch. 25/04/2036 ^		167	131	0,01
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
2,984 % éch. 25/01/2036 ^		30	26	0,00
3,632 % éch. 25/09/2047 ^		69	56	0,01
3,677 % éch. 20/02/2036		144	108	0,01
3,777 % éch. 20/09/2036 ^		24	19	0,00
3,802 % éch. 25/11/2037		91	74	0,01
3,869 % éch. 20/12/2035 ^		58	44	0,00
4,989 % éch. 25/03/2035		262	170	0,01
5,009 % éch. 25/03/2035		16	13	0,00
5,129 % éch. 25/02/2035		186	145	0,01
5,750 % éch. 25/12/2035 ^		68	34	0,00
6,000 % éch. 25/03/2037 ^		92	43	0,00
6,000 % éch. 25/04/2037 ^		14	7	0,00
6,000 % éch. 25/07/2037		162	73	0,01
6,500 % éch. 25/11/2036 ^		264	98	0,01
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
5,539 % éch. 25/09/2034 ^		36	36	0,00
6,000 % éch. 25/01/2036 ^		160	93	0,01
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				
4,689 % éch. 25/08/2036 ^		1 200	326	0,03
6,000 % éch. 25/07/2036		186	94	0,01
6,500 % éch. 25/10/2021 ^		199	14	0,00
6,500 % éch. 25/02/2022 ^		513	63	0,01
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				
4,689 % éch. 25/04/2037		188	124	0,01
Dutch Property Finance BV				
2,328 % éch. 28/10/2059	€	6 948	6 846	0,51
EuroMASTR PLC				
3,996 % éch. 15/06/2040	£	126	132	0,01
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				
3,938 % éch. 25/04/2036 ^	$	53	42	0,00
4,088 % éch. 25/01/2036 ^		154	81	0,01
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				
4,282 % éch. 25/11/2037 ^		28	23	0,00
GSC Capital Corp. Mortgage Trust				
4,749 % éch. 25/05/2036 ^		68	58	0,01
GSR Mortgage Loan Trust				
5,500 % éch. 25/06/2035		107	97	0,01
HarborView Mortgage Loan Trust				
3,529 % éch. 19/06/2036 ^		101	54	0,00
3,756 % éch. 19/12/2035 ^		87	44	0,00
3,928 % éch. 19/12/2035 ^		17	15	0,00
Hops Hill PLC				
4,382 % éch. 27/05/2054	£	914	1 020	0,08
HSI Asset Loan Obligation Trust				
6,000 % éch. 25/06/2037 ^	$	77	61	0,01
Impac Secured Assets Trust				
4,689 % éch. 25/11/2036		68	63	0,01
IndyMac Mortgage Loan Trust				
3,129 % éch. 25/06/2036		42	31	0,00
3,196 % éch. 25/11/2035 ^		89	72	0,01
3,324 % éch. 25/06/2037 ^		1 075	696	0,05
5,109 % éch. 25/01/2035		49	36	0,00
6,250 % éch. 25/11/2037 ^		42	19	0,00
JPMorgan Alternative Loan Trust				
3,741 % éch. 25/12/2036		5	4	0,00
4,529 % éch. 27/06/2037		176	123	0,01
4,869 % éch. 25/10/2036		3 016	2 481	0,18
6,500 % éch. 25/03/2036 ^		187	102	0,01
6,550 % éch. 25/05/2036		4	4	0,00
Jubilee Place BV				
2,228 % éch. 17/01/2059	€	5 687	5 588	0,41
2,378 % éch. 17/10/2057		1 331	1 320	0,10

Tableau des investissements Fonds Euro Income Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Lavender Trust					
6,250 % éch. 26/10/2036	$	166	€	83	0,01
Lehman Mortgage Trust					
4,663 % éch. 25/12/2035		159		31	0,00
5,071 % éch. 25/01/2036 ^		48		40	0,00
Lehman XS Trust					
4,749 % éch. 25/12/2036		747		657	0,05
Mansard Mortgages PLC					
4,172 % éch. 15/12/2049	£	45		48	0,00
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust					
2,983 % éch. 25/03/2035	$	14		12	0,00
Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust					
6,000 % éch. 25/05/2037 ^		128		93	0,01
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust					
2,736 % éch. 25/03/2036 ^		271		139	0,01
Miravet SARL					
2,758 % éch. 26/05/2065	€	5 653		5 465	0,40
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust					
3,665 % éch. 25/03/2036 ^	$	118		75	0,01
5,962 % éch. 25/06/2036 ^		4 463		1 280	0,10
6,000 % éch. 25/10/2037 ^		112		62	0,01
Newgate Funding PLC					
2,646 % éch. 15/12/2050	€	206		192	0,02
4,796 % éch. 15/12/2050	£	164		172	0,01
Primrose Residential DAC					
2,894 % éch. 24/10/2061	€	5 002		4 876	0,36
Residential Accredit Loans, Inc. Trust					
4,809 % éch. 25/06/2037	$	52		43	0,00
6,000 % éch. 25/06/2036 ^		60		46	0,00
6,000 % éch. 25/05/2037 ^		47		35	0,00
6,250 % éch. 25/02/2037 ^		129		94	0,01
Residential Asset Securitization Trust					
6,000 % éch. 25/02/2036		323		137	0,01
6,000 % éch. 25/06/2036		145		58	0,01
6,000 % éch. 25/11/2036 ^		121		43	0,00
6,000 % éch. 25/03/2037 ^		97		31	0,00
6,000 % éch. 25/05/2037 ^		655		357	0,03
6,250 % éch. 25/11/2036 ^		83		31	0,00
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust					
6,000 % éch. 25/10/2036 ^		39		29	0,00
RMAC Securities PLC					
3,676 % éch. 12/06/2044	£	436		450	0,03
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust					
3,550 % éch. 25/02/2036 ^	$	57		43	0,00
4,113 % éch. 25/10/2035 ^		129		106	0,01
SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust					
3,128 % éch. 25/02/2037 ^		77		62	0,01
TBW Mortgage-Backed Trust					
6,300 % éch. 25/03/2037		8 619		1 953	0,15
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
3,342 % éch. 25/05/2037 ^		44		36	0,00
3,600 % éch. 25/12/2036 ^		255		204	0,02
3,672 % éch. 25/10/2036 ^		30		24	0,00
3,770 % éch. 25/12/2035		10		9	0,00
5,169 % éch. 25/10/2044		60		51	0,00
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
2,818 % éch. 25/04/2047		367		267	0,02
6,000 % éch. 25/07/2036 ^		97		63	0,01
6,000 % éch. 25/06/2037 ^		26		24	0,00
Wells Fargo Alternative Loan Trust					
6,250 % éch. 25/11/2037 ^		32		25	0,00
				46 770	3,46

TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS

Accunia European CLO DAC					
2,328 % éch. 15/07/2030	€	713		699	0,05
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust					
4,499 % éch. 25/12/2036	$	418		114	0,01
4,669 % éch. 25/07/2036		108		81	0,01
5,364 % éch. 25/11/2033		781		697	0,05
ALME Loan Funding DAC					
2,128 % éch. 15/01/2032	€	292		283	0,02
Aqueduct European CLO DAC					
2,096 % éch. 20/07/2030		3 231		3 167	0,23
2,728 % éch. 15/08/2034		1 000		960	0,07
Ares European CLO DAC					
2,038 % éch. 15/10/2030	€	698	€	681	0,05
2,306 % éch. 20/04/2032		2 100		2 040	0,15
2,582 % éch. 21/10/2033		8 500		8 328	0,62
Argent Securities Trust					
4,539 % éch. 25/09/2036	$	862		270	0,02
4,589 % éch. 25/06/2036		465		123	0,01
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					
5,029 % éch. 25/01/2036		494		403	0,03
Asset-Backed Funding Certificates Trust					
5,389 % éch. 25/06/2037		74		55	0,00
5,439 % éch. 25/03/2034 ^		116		103	0,01
Aurium CLO DAC					
2,048 % éch. 16/04/2030	€	2 092		2 051	0,15
Bain Capital Euro CLO DAC					
2,602 % éch. 24/01/2033		400		391	0,03
Bastille Euro CLO DAC					
2,528 % éch. 15/01/2034		8 200		7 914	0,59
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust					
3,847 % éch. 25/10/2036	$	33		19	0,00
5,289 % éch. 25/08/2034		931		831	0,06
Black Diamond CLO DAC					
2,834 % éch. 03/10/2029	€	54		54	0,00
Blackrock European CLO DAC					
2,946 % éch. 15/12/2032		600		583	0,04
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC					
2,028 % éch. 15/07/2030		2 035		1 988	0,15
2,288 % éch. 15/01/2033		2 300		2 215	0,16
BNPP AM Euro CLO DAC					
2,028 % éch. 15/10/2031		1 134		1 112	0,08
BNPP IP Euro CLO DAC					
2,168 % éch. 15/10/2030		1 000		974	0,07
Bosphorus CLO DAC					
2,866 % éch. 15/12/2030		1 062		1 035	0,08
Cairn CLO DAC					
2,275 % éch. 31/01/2030		4 295		4 211	0,31
2,333 % éch. 25/07/2029		3 041		3 016	0,22
2,688 % éch. 20/10/2028		193		189	0,01
Carlyle Euro CLO DAC					
2,428 % éch. 15/08/2030		6 377		6 224	0,46
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC					
2,128 % éch. 15/07/2030		1 297		1 263	0,09
Carrington Mortgage Loan Trust					
4,649 % éch. 25/02/2037	$	148		125	0,01
Centex Home Equity Loan Trust					
5,439 % éch. 25/10/2035		4 024		3 594	0,27
Citigroup Mortgage Loan Trust					
6,851 % éch. 25/05/2036 ^		132		46	0,00
Contego CLO BV					
2,148 % éch. 15/10/2030	€	1 299		1 270	0,09
Contego CLO DAC					
2,142 % éch. 23/01/2030		5 540		5 399	0,40
CVC Cordatus Loan Fund DAC					
2,112 % éch. 21/07/2030		10 930		10 715	0,79
2,578 % éch. 15/08/2032		200		195	0,02
2,788 % éch. 26/08/2032		500		484	0,04
2,962 % éch. 17/06/2032		1 300		1 251	0,09
Dryden Euro CLO DAC					
2,512 % éch. 15/05/2032		600		583	0,04
2,622 % éch. 15/05/2034		300		292	0,02
First NLC Trust					
4,529 % éch. 25/08/2037	$	142		63	0,01
4,669 % éch. 25/08/2037		47		21	0,00
Fremont Home Loan Trust					
4,539 % éch. 25/01/2037		218		93	0,01
4,709 % éch. 25/08/2036		188		61	0,01
4,729 % éch. 25/02/2037		661		221	0,02
Griffith Park CLO DAC					
2,522 % éch. 21/11/2031	€	3 300		3 195	0,24
Grosvenor Place CLO BV					
2,325 % éch. 30/10/2029		1 008		997	0,07
GSAA Home Equity Trust					
5,772 % éch. 25/11/2036 ^	$	127		36	0,00
GSAMP Trust					
4,489 % éch. 25/12/2046		189		89	0,01
4,529 % éch. 25/12/2036	$	860	€	437	0,03
4,539 % éch. 25/12/2046		520		244	0,02
4,589 % éch. 25/11/2036		195		88	0,01
4,619 % éch. 25/12/2046		94		44	0,00
4,689 % éch. 25/09/2036		362		125	0,01
Harvest CLO DAC					
2,018 % éch. 15/10/2031	€	1 400		1 361	0,10
2,108 % éch. 15/01/2031		994		971	0,07
2,406 % éch. 20/10/2032		2 000		1 927	0,14
2,433 % éch. 18/11/2029		197		194	0,01
2,673 % éch. 18/11/2030		2 308		2 265	0,17
HSI Asset Securitization Corp. Trust					
4,609 % éch. 25/12/2036	$	199		51	0,00
4,729 % éch. 25/12/2036		958		244	0,02
4,829 % éch. 25/12/2036		555		142	0,01
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.					
5,319 % éch. 25/06/2035		4 968		4 217	0,31
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust					
6,337 % éch. 25/08/2036 ^		92		52	0,00
Jubilee CLO DAC					
1,988 % éch. 15/04/2030	€	700		684	0,05
2,128 % éch. 12/07/2028		115		115	0,01
2,846 % éch. 15/12/2029		1 682		1 650	0,12
Lehman XS Trust					
4,559 % éch. 25/02/2037 ^	$	1 011		787	0,06
Mackay Shields Euro CLO DAC					
2,386 % éch. 20/10/2032	€	1 300		1 254	0,09
Man GLG Euro CLO DAC					
2,058 % éch. 15/10/2030		657		642	0,05
2,248 % éch. 15/01/2030		4 001		3 913	0,29
Marlay Park CLO DAC					
2,118 % éch. 15/10/2030		1 400		1 369	0,10
MASTR Asset-Backed Securities Trust					
4,489 % éch. 25/11/2036	$	137		42	0,00
4,689 % éch. 25/08/2036		241		92	0,01
4,869 % éch. 25/06/2036		130		49	0,00
4,869 % éch. 25/08/2036		145		55	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust					
4,689 % éch. 25/11/2037		626		210	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust					
4,499 % éch. 25/02/2037		486		154	0,01
4,519 % éch. 25/01/2037		101		47	0,00
4,529 % éch. 25/10/2036		110		49	0,00
4,569 % éch. 25/03/2037		328		139	0,01
4,589 % éch. 25/09/2036		56		20	0,00
4,589 % éch. 25/02/2037		112		51	0,00
4,639 % éch. 25/03/2037		328		139	0,01
4,689 % éch. 25/09/2036		331		119	0,01
5,439 % éch. 25/06/2033		6		5	0,00
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust					
4,559 % éch. 25/04/2037		267		137	0,01
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust					
6,465 % éch. 25/09/2046 ^		298		107	0,01
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust					
6,032 % éch. 25/10/2036 ^		156		37	0,00
NovaStar Mortgage Funding Trust					
4,689 % éch. 25/06/2036		84		60	0,00
4,689 % éch. 25/09/2036		151		62	0,01
4,709 % éch. 25/05/2036		317		289	0,02
Oak Hill European Credit Partners DAC					
2,186 % éch. 20/01/2032	€	3 147		3 072	0,23
Oak Hill European Credit Partners Ltd.					
2,356 % éch. 22/07/2030		1 720		1 703	0,13
OCP Euro CLO DAC					
2,198 % éch. 15/01/2032		4 693		4 606	0,34
Option One Mortgage Loan Trust					
4,609 % éch. 25/01/2037	$	260		145	0,01
4,719 % éch. 25/04/2037		100		45	0,00
Palmer Square European Loan Funding DAC					
2,098 % éch. 15/10/2031	€	5 770		5 595	0,41
Palmerston Park CLO DAC					
2,053 % éch. 18/04/2030		1 513		1 487	0,11
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					
5,124 % éch. 25/08/2035	$	442		396	0,03
Purple Finance CLO DAC					
2,456 % éch. 20/04/2032	€	1 200		1 165	0,09

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Renaissance Home Equity Loan Trust			
5,879 % éch. 25/06/2037 ^	$ 3 494	€ 1 046	0,08
6,189 % éch. 25/09/2037	158	127	0,01
7,238 % éch. 25/09/2037 ^	216	95	0,01
Residential Asset Mortgage Products Trust			
5,334 % éch. 25/10/2035	3 000	2 267	0,17
Residential Asset Securities Corp. Trust			
4,649 % éch. 25/11/2036	751	640	0,05
Rockford Tower Europe CLO DAC			
3,077 % éch. 20/12/2031	€ 600	585	0,04
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
4,569 % éch. 25/07/2036	$ 195	65	0,01
4,709 % éch. 25/07/2036	191	64	0,01
4,869 % éch. 25/07/2036	163	55	0,00
4,889 % éch. 25/05/2036	673	343	0,03
Segovia European CLO DAC			
2,173 % éch. 18/01/2031	€ 294	288	0,02
2,336 % éch. 20/07/2032	2 000	1 936	0,14
Soundview Home Loan Trust			
4,499 % éch. 25/02/2037	$ 266	72	0,01
4,569 % éch. 25/02/2037	394	107	0,01
4,669 % éch. 25/06/2037	142	95	0,01
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
4,689 % éch. 25/09/2037	67	44	0,00
St. Paul's CLO DAC			
2,138 % éch. 17/07/2030	€ 1 497	1 457	0,11
Structured Asset Investment Loan Trust			
4,539 % éch. 25/09/2036	$ 33	30	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
6,139 % éch. 25/04/2031	1 879	1 721	0,13
Toro European CLO DAC			
2,118 % éch. 15/10/2030	€ 1 199	1 175	0,09
2,239 % éch. 12/01/2032	9 200	8 863	0,66
2,298 % éch. 15/07/2030	2 390	2 349	0,17
Voya Euro CLO DAC			
2,128 % éch. 15/10/2030	4 298	4 208	0,31
		151 289	11,18
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Bpifrance Financement S.A.			
3,000 % éch. 10/09/2026	800	793	0,06
Obligation internationale du gouvernement français			
0,000 % éch. 25/03/2023 (c)	7 150	7 118	0,53
Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire			
5,250 % éch. 22/03/2030	6 000	5 087	0,38
Obligation internationale du gouvernement russe			
2,875 % éch. 04/12/2025 ^	€ 4 000	€ 1 160	0,08
Obligation internationale du gouvernement ukrainien			
7,750 % éch. 01/09/2025 ^	$ 6 500	1 408	0,10
		15 566	1,15
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BILLETS À COURT TERME			
Corestate Capital Holding S.A.			
8,000 % éch. 15/04/2023 (g)	€ 700	700	0,05
BONS DU TRÉSOR BELGE			
1,641 % éch. 09/03/2023 (c)(d)	700	697	0,05
1,643 % éch. 09/03/2023 (c)(d)	700	698	0,05
		1 395	0,10
BONS DU TRÉSOR DU MÉCANISME EUROPÉEN DE STABILISATION			
1,754 % éch. 09/03/2023 (c)(d)	2 430	2 422	0,18
1,755 % éch. 09/03/2023 (c)(d)	3 030	3 021	0,22
1,760 % éch. 09/03/2023 (c)(d)	3 040	3 030	0,23
		8 473	0,63
BONS DU TRÉSOR DE L'UNION EUROPÉENNE			
0,233 % éch. 06/01/2023 (c)(d)	3 900	3 900	0,29
1,217 % éch. 06/01/2023 (c)(d)	150	150	0,01
1,351 % éch. 03/02/2023 (c)(d)	3 500	3 496	0,26
1,369 % éch. 03/03/2023 (c)(d)	5 000	4 985	0,37
1,666 % éch. 03/03/2023 (c)(d)	9 180	9 153	0,68
1,668 % éch. 03/03/2023 (c)(d)	9 900	9 871	0,73
1,764 % éch. 03/03/2023 (c)(d)	1 100	1 097	0,08
2,185 % éch. 09/06/2023 (c)(d)	12 210	12 084	0,89
		44 736	3,31
BONS DU TRÉSOR FRANÇAIS			
0,253 % éch. 04/01/2023 (c)(d)	13 700	13 700	1,01
0,740 % éch. 08/02/2023 (c)(d)	2 300	2 297	0,17
0,904 % éch. 08/02/2023 (c)(d)	2 300	2 297	0,17
0,918 % éch. 08/02/2023 (c)(d)	2 500	2 497	0,18
0,994 % éch. 22/02/2023 (c)(d)	2 500	2 495	0,18
1,282 % éch. 08/02/2023 (c)(d)	3 500	3 495	0,26
1,600 % éch. 22/03/2023 (c)(d)	1 200	1 195	0,09
1,612 % éch. 22/03/2023 (c)(d)	1 150	1 146	0,09
1,625 % éch. 22/03/2023 (c)(d)	1 200	1 196	0,09
1,735 % éch. 15/03/2023 (c)(d)	2 550	2 541	0,19
		32 859	2,43
BONS DU TRÉSOR ALLEMAND			
0,958 % éch. 18/01/2023 (c)(d)	€ 5 290	€ 5 288	0,39
1,257 % éch. 22/02/2023 (c)(d)	720	719	0,05
1,925 % éch. 17/05/2023 (c)(d)	420	417	0,03
1,954 % éch. 17/05/2023 (c)(d)	5 420	5 381	0,40
		11 805	0,87
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS			
(0,198) % éch. 27/03/2023 (c)(d)	¥ 4 410 200	31 331	2,32
(0,179) % éch. 27/03/2023 (c)(d)	5 469 800	38 859	2,87
		70 190	5,19
BONS DU TRÉSOR ESPAGNOL			
1,441 % éch. 13/01/2023 (c)(d)	€ 250	250	0,02
1,460 % éch. 13/01/2023 (c)(d)	350	350	0,02
		600	0,04
Total des Instruments à court terme		170 758	12,62
Total des Valeurs mobilières		**€ 1 100 441**	**81,34**

	ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (e)	1 494 064	14 761	1,09
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (e)	1 261 200	120 054	8,87
Total des Fonds d'investissement		**€ 134 815**	**9,96**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BPS	(1,000) %	30/12/2022	02/01/2023	€ 16 600	BNG Bank NV 0,875 % échéance 24/10/2036	€ (16 819)	€ 16 600	€ 16 599	1,23
COM	(0,500)	30/12/2022	02/01/2023	100 000	Land Berlin 0,625 % échéance 08/02/2027	(102 209)	100 000	99 996	7,38
FICC	1,900	30/12/2022	03/01/2023	$ 4 117	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 29/06/2023	(3 935)	3 858	3 858	0,29
Total des Contrats de mise en pension						**€ (122 963)**	**€ 120 458**	**€ 120 453**	**8,90**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Long	03/2023	189	€ (1 621)	(0,12)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars	Court	03/2023	3 801	5 121	0,38
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Long	03/2023	802	(958)	(0,07)
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Court	03/2023	17	123	0,01
				€ 2 665	0,20
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**€ 2 665**	**0,20**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AT&T, Inc.	1,000 %	20/06/2024	$ 13 000	€ (132)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	9 700	(140)	(0,01)
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2025	200	3	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2024	4 400	86	0,01
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	11 700	(14)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2026	1 300	(7)	0,00
Syngenta Finance NV	1,000	20/06/2028	€ 800	(18)	0,00
Tesco PLC	1,000	20/06/2028	500	(13)	0,00
Valeo S.A.	1,000	20/06/2028	400	(24)	(0,01)
				€ (259)	(0,02)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000 %	20/12/2027	$ 71 800	€ (325)	(0,02)
Indice CDX.IG-38 à 5 ans	1,000	20/06/2027	1 000	(1)	0,00
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000	20/12/2027	2 700	18	0,00
Indice iTraxx Crossover 38 à 5 ans	5,000	20/12/2027	€ 42 400	2 124	0,16
Indice iTraxx Europe Main 37 à 5 ans	1,000	20/06/2027	82 500	335	0,02
				€ 2 151	0,16

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000 %	15/03/2053	£ 3 000	€ (117)	(0,01)
À recevoir[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250	15/03/2028	26 500	767	0,06
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	15/06/2032	¥ 8 530 000	2 580	0,19
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024	$ 215 000	3 418	0,25
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,868	05/05/2032	15 100	(1 842)	(0,14)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,040	25/05/2032	7 800	(845)	(0,06)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,068	11/05/2032	15 400	(1 639)	(0,12)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,153	18/05/2032	15 400	(1 522)	(0,11)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,270	04/11/2023	220 700	(7 170)	(0,53)
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	0,830	09/12/2052	€ 22 000	609	0,04
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028	137 700	(3 476)	(0,26)
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053	47 000	5 289	0,39
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,520	07/07/2027	9 600	(587)	(0,04)
					€ (4 535)	(0,34)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**€ (2 643)**	**(0,20)**

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

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

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

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

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

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente - Indice iTraxx Europe 37 à 5 ans hors cote	Vente	3,000 %	15/03/2023	3 300	€ (6)	€ (1)	0,00

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,500 %	07/02/2023	115 000	€ (333)	€ (3 211)	(0,24)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	ADLER Real Estate AG	5,000 %	20/12/2026	€ 1 200	€ (7)	€ (281)	€ (288)	(0,02)

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

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

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€	26 518	DKK	197 230	€ 6	€ 0	€ 6	0,00
	01/2023		9 514	$	10 128	0	(29)	(29)	0,00
	01/2023	$	11 670	BRL	62 172	96	0	96	0,01
	01/2023		12 636	€	11 884	49	0	49	0,00
	02/2023	CAD	124		90	4	0	4	0,00
	02/2023	£	190		215	1	0	1	0,00
	03/2023	$	3 762	MXN	74 756	22	0	22	0,00
BPS	01/2023		34 984	€	32 845	79	0	79	0,01
	03/2023	INR	19 159	$	231	1	0	1	0,00
	03/2023	$	10 740	MXN	216 455	195	0	195	0,01
BRC	01/2023		5 456	€	5 114	4	0	4	0,00
	01/2023		7 313	KRW	9 430 845	171	0	171	0,01
CBK	01/2023	€	8 529	$	9 071	0	(33)	(33)	0,00
	01/2023	$	31	BRL	161	0	0	0	0,00
	01/2023		11 739	€	11 020	25	0	25	0,00
	02/2023	€	1 337	£	1 181	0	(8)	(8)	0,00
GLM	01/2023	BRL	62 333	$	11 696	0	(100)	(100)	(0,01)
	01/2023	CNH	216		31	0	0	0	0,00
	03/2023	MXN	195 687		9 519	0	(354)	(354)	(0,03)
	04/2023	$	11 491	BRL	62 333	102	0	102	0,01
JPM	01/2023	€	4 948	DKK	36 800	1	0	1	0,00
	02/2023	TWD	310	$	10	0	0	0	0,00
	03/2023	IDR	282 387		18	0	0	0	0,00
	03/2023	¥	9 884 973	€	68 267	0	(2 315)	(2 315)	(0,17)
MBC	01/2023	DKK	7 320		984	0	0	0	0,00
	01/2023	€	4 084	$	4 326	0	(32)	(32)	0,00
	01/2023	$	217 231	€	207 268	3 812	0	3 812	0,28
	02/2023	AUD	50		32	1	0	1	0,00
	03/2023	IDR	171 508	$	11	0	0	0	0,00
	05/2023	CNH	30 884		4 602	88	0	88	0,01
MYI	01/2023	€	19 230	DKK	143 045	7	0	7	0,00
	01/2023		8 756	$	9 170	0	(167)	(167)	(0,01)
	01/2023	$	7 894	€	7 424	30	0	30	0,00
	02/2023	¥	48 304		336	0	(8)	(8)	0,00
	02/2023	TWD	574	$	19	0	0	0	0,00
	02/2023	$	142	ZAR	2 604	10	0	10	0,00
	03/2023	IDR	241 503	$	15	0	0	0	0,00
RBC	02/2023	€	5 552	£	4 810	0	(141)	(141)	(0,01)
	02/2023		1 140	¥	161 300	8	0	8	0,00
	03/2023	$	4	MXN	78	0	0	0	0,00
	04/2023	MXN	18 319	$	884	0	(35)	(35)	0,00
RYL	01/2023	$	600	€	577	15	0	15	0,00
	02/2023	€	13 756	AUD	21 380	0	(186)	(186)	(0,01)
	02/2023		13 540	¥	1 942 600	292	0	292	0,02
	02/2023		3 437	NOK	35 780	0	(38)	(38)	0,00
SCX	01/2023	DKK	638 976	€	85 948	18	0	18	0,00
	02/2023	€	1 963	£	1 693	0	(59)	(59)	0,00
	02/2023	TWD	3 473	$	113	0	(1)	(1)	0,00
SSB	02/2023	£	27 154	€	30 939	387	0	387	0,03
	03/2023	$	7 357	IDR	114 511 705	41	0	41	0,00
UAG	03/2023		3 307	MXN	65 709	19	0	19	0,00
	05/2023		4 351	CNH	30 155	46	0	46	0,00
						€ 5 530	€ (3 506)	€ 2 024	0,15

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**€ (1 476)**	**(0,11)**
Total des Investissements	**€ 1 354 260**	**100,09**
Autres actifs et passifs à court terme	**€ (1 280)**	**(0,09)**
Actif net	**€ 1 352 980**	**100,00**

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titre convertible conditionnel.

(g) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,19 %) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Corestate Capital Holding S.A.	8,000 %	15/04/2023	06/12/2022	€ 700	€ 700	0,05
Deutsche Bank AG	3,035	28/05/2032	29/07/2021	173	142	0,01
				€ 873	€ 842	0,06

Un titre d'une juste valeur globale de 0 € (31 décembre 2021 : 3 312 €) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 41 642 € (31 décembre 2021 : 61 805 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 5 462 € (31 décembre 2021 : 2 269 € a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	€ 0	€ 1 098 581	€ 1 860	€ 1 100 441
Fonds d'investissement	134 815	0	0	134 815
Contrats de mise en pension	0	120 458	0	120 458
Instruments financiers dérivés[3]	3 623	(5 077)	0	(1 454)
Totaux	**€ 138 438**	**€ 1 213 962**	**€ 1 860**	**€ 1 354 260**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	€ 0	€ 2 206 773	€ 0	€ 2 206 773
Fonds d'investissement	95 911	80 957	0	176 868
Contrats de mise en pension	0	7 551	0	7 551
Instruments financiers dérivés[3]	863	15 756	(32)	16 587
Totaux	**€ 96 774**	**€ 2 311 037**	**€ (32)**	**€ 2 407 779**

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

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

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	€ 149	€ (272)	€ (123)	€ (68)	€ 0	€ (68)
BPS	275	(290)	(15)	50	0	50
BRC	175	0	175	(88)	0	(88)
CBK	(16)	0	(16)	11	0	11
DUB	S/O	S/O	S/O	53	0	53
FBF	S/O	S/O	S/O	262	(229)	33
GLM	(3 563)	3 382	(181)	(1 761)	2 023	262
GST	(289)	328	39	1 171	(1 301)	(130)
HUS	S/O	S/O	S/O	(126)	246	120

Contrepartie	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
JPM	€ (2 314)	€ 1 752	€ (562)	€ 2 018	€ (2 207)	€ (189)
MBC	3 869	(3 429)	440	S/O	S/O	S/O
MYC	S/O	S/O	S/O	5	(9)	(4)
MYI	(128)	0	(128)	(170)	0	(170)
RBC	(168)	0	(168)	3	0	3
RYL	83	0	83	S/O	S/O	S/O
SCX	(42)	0	(42)	4 527	(2 647)	1 880
SSB	428	(272)	156	S/O	S/O	S/O
UAG	65	0	65	S/O	S/O	S/O

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	60,94	77,13
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	19,96	8,49
Autres valeurs mobilières	0,44	3,28
Fonds d'investissement	9,96	7,13
Contrats de mise en pension	8,90	0,30
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,20	0,06
Instruments financiers dérivés compensés	(0,20)	0,37
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,11)	0,24
Contrats de prise en pension	S/O	(0,13)

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Crédits consortiaux et cessions	2,26	5,73
Obligations et billets privés	43,78	69,07
Obligations et billets convertibles	0,11	0,28
Agences du gouvernement américain	6,78	S/O
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	3,46	4,91
Titres adossés à des actifs	11,18	5,01
Émissions souveraines	1,15	3,84
Instruments à court terme	12,62	0,06
Fonds d'investissement	9,96	7,13
Contrats de mise en pension	8,90	0,30
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,20	0,06
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,02)	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,16	0,03
Swaps de taux d'intérêt	(0,34)	0,34
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,24)	(0,03)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,02)	0,14
Contrats de change à terme	0,15	0,13
Autres actifs et passifs à court terme	(0,09)	3,00
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Euro Long Average Duration Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
BANQUE ET FINANCE					
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.					
3,205 % éch. 15/11/2024	€	300	€	298	0,27
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.					
5,875 % éch. 24/09/2023 (c)(e)		200		193	0,18
Banco Santander S.A.					
2,375 % éch. 08/09/2027		700		669	0,61
Coventry Building Society					
2,625 % éch. 07/12/2026		100		97	0,09
Credit Suisse Schweiz AG					
3,390 % éch. 05/12/2025		600		592	0,54
Deutsche Bank AG					
2,250 % éch. 20/09/2027		200		192	0,17
Fédération des Caisses Desjardins du Québec					
2,875 % éch. 28/11/2024		300		297	0,27
Jyske Realkredit A/S					
1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	12		1	0,00
1,000 % éch. 01/10/2053		0		0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		3		0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2050		16		2	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab					
1,000 % éch. 01/10/2050		3 481		326	0,30
1,500 % éch. 01/10/2050		0		0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2047		0		0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2050		19		2	0,00
Nykredit Realkredit A/S					
1,000 % éch. 01/10/2050		26 832		2 517	2,29
1,000 % éch. 01/10/2053		951		92	0,08
1,500 % éch. 01/10/2047		1		0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		0		0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		93		9	0,01
2,000 % éch. 01/10/2047		0		0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2050		23		2	0,00
2,000 % éch. 01/10/2053		2 982		319	0,29
3,000 % éch. 01/10/2053		1 090		130	0,12
3,500 % éch. 01/10/2053		6 074		751	0,68
5,000 % éch. 01/10/2053		10		1	0,00
Permanent TSB Group Holdings PLC					
5,250 % éch. 30/06/2025	€	100		96	0,09
Realkredit Danmark A/S					
1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	3 716		369	0,33
1,500 % éch. 01/10/2053		2 786		273	0,25
2,000 % éch. 01/10/2047		0		0	0,00
3,000 % éch. 01/10/2053		2 878		344	0,31
Royal Bank of Canada					
2,375 % éch. 13/09/2027	€	300		287	0,26
SLM Student Loan Trust					
2,596 % éch. 15/12/2033		470		449	0,41
Sparebanken Soer Boligkreditt A/S					
3,125 % éch. 14/11/2025		200		199	0,18
				8 507	7,73
INDUSTRIE					
SK Hynix, Inc.					
1,000 % éch. 19/01/2024	$	200		178	0,16
Total des Obligations et billets privés				8 685	7,89
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN					
Fannie Mae					
2,560 % éch. 01/08/2036		1		1	0,00
3,821 % éch. 25/07/2037		5		5	0,00
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)					
3,500 % éch. 01/07/2048		492		426	0,39
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA					
3,000 % éch. 01/02/2053		1 650		1 358	1,23
4,000 % éch. 01/02/2053		3 550		3 121	2,84
4,500 % éch. 01/02/2053		1 000		902	0,82
				5 813	5,28
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN					
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (b)					
0,125 % éch. 15/01/2032		1 505		1 236	1,12
0,500 % éch. 15/01/2028		846		745	0,68
1,625 % éch. 15/10/2027	$	2 012	€	1 884	1,71
				3 865	3,51
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX					
Alba PLC					
2,206 % éch. 15/12/2038	€	207		191	0,17
Avon Finance PLC					
4,331 % éch. 20/09/2048	£	525		580	0,53
Barley Hill PLC					
4,352 % éch. 27/08/2058		123		137	0,12
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust					
3,653 % éch. 25/07/2033	$	4		4	0,00
Canada Square Funding PLC					
4,205 % éch. 17/06/2058	£	266		289	0,26
Canterbury Finance PLC					
4,335 % éch. 16/05/2057		28		32	0,03
Charter Mortgage Funding PLC					
3,935 % éch. 16/01/2057		75		84	0,08
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates					
3,139 % éch. 25/07/2033	$	5		4	0,00
Dilosk RMBS DAC					
2,552 % éch. 20/02/2060	€	254		252	0,23
2,747 % éch. 20/12/2060		456		451	0,41
Dutch Property Finance BV					
2,228 % éch. 28/07/2054		355		352	0,32
2,228 % éch. 28/07/2058		312		308	0,28
2,278 % éch. 28/04/2059		442		435	0,39
2,328 % éch. 28/10/2059		376		370	0,34
2,828 % éch. 28/04/2050		300		293	0,27
Eurohome UK Mortgages PLC					
3,946 % éch. 15/06/2044	£	151		162	0,15
Finsbury Square PLC					
4,709 % éch. 16/06/2070		131		148	0,13
Great Hall Mortgages PLC					
2,192 % éch. 18/03/2039	€	54		53	0,05
4,868 % éch. 18/06/2039	$	20		19	0,02
Jubilee Place BV					
2,228 % éch. 17/01/2059	€	451		443	0,40
2,378 % éch. 17/10/2057		99		98	0,09
Landmark Mortgage Securities PLC					
3,066 % éch. 17/06/2039	£	183		194	0,18
3,668 % éch. 17/04/2044		706		747	0,68
Lanebrook Mortgage Transaction PLC					
3,576 % éch. 20/07/2058		186		203	0,18
Ludgate Funding PLC					
3,490 % éch. 01/01/2061		83		88	0,08
3,869 % éch. 01/12/2060		209		221	0,20
Newgate Funding PLC					
2,646 % éch. 15/12/2050	€	722		673	0,61
Polaris PLC					
4,222 % éch. 23/12/2058	£	258		284	0,26
4,232 % éch. 23/10/2059		287		316	0,29
4,682 % éch. 27/05/2057		150		168	0,15
Precise Mortgage Funding PLC					
4,587 % éch. 12/12/2055		232		260	0,24
Primrose Residential DAC					
2,644 % éch. 24/03/2061	€	337		329	0,30
2,894 % éch. 24/10/2061		556		542	0,49
Ripon Mortgages PLC					
4,011 % éch. 28/08/2056	£	344		381	0,35
RMAC Securities PLC					
3,656 % éch. 12/06/2044		201		207	0,19
Shamrock Residential DAC					
2,744 % éch. 24/12/2059	€	157		154	0,14
Stanlington PLC					
4,337 % éch. 12/06/2045	£	255		281	0,26
Stratton Mortgage Funding PLC					
3,826 % éch. 20/07/2060		583		652	0,59
4,287 % éch. 12/03/2052		204		229	0,21
4,292 % éch. 25/09/2051		300		333	0,30
Structured Asset Mortgage Investments Trust					
4,839 % éch. 19/07/2035	$	13		11	0,01
Thornburg Mortgage Securities Trust					
5,029 % éch. 25/09/2043		19		17	0,02
Towd Point Mortgage Funding PLC					
4,071 % éch. 20/10/2051	£	378	€	423	0,38
4,171 % éch. 20/05/2045		314		349	0,32
Tower Bridge Funding PLC					
4,051 % éch. 20/11/2063		439		486	0,44
4,151 % éch. 20/12/2063		184		203	0,18
Trinity Square PLC					
3,729 % éch. 15/07/2059		360		401	0,36
Tudor Rose Mortgages					
4,031 % éch. 20/06/2048		257		285	0,26
Twin Bridges PLC					
4,237 % éch. 12/03/2055		325		359	0,33
4,637 % éch. 12/12/2054		163		183	0,17
				13 684	12,44
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS					
Accunia European CLO DAC					
2,308 % éch. 15/10/2030	€	145		143	0,13
2,328 % éch. 15/07/2030		624		612	0,56
Ares European CLO DAC					
2,038 % éch. 15/10/2030		199		195	0,18
Avoca CLO DAC					
2,198 % éch. 15/10/2032		300		290	0,26
Bain Capital Euro CLO DAC					
2,196 % éch. 20/01/2032		200		195	0,18
BBVA Consumer Auto					
0,270 % éch. 20/07/2031		82		80	0,07
Black Diamond CLO DAC					
2,316 % éch. 20/01/2032		482		471	0,43
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC					
1,050 % éch. 15/01/2031		100		90	0,08
2,028 % éch. 15/07/2030		313		306	0,28
2,098 % éch. 15/01/2031		500		486	0,44
2,288 % éch. 15/01/2033		400		385	0,35
BNPP AM Euro CLO DAC					
2,028 % éch. 15/10/2031		247		242	0,22
2,322 % éch. 22/07/2032		400		388	0,35
Cairn CLO DAC					
2,158 % éch. 15/10/2031		600		587	0,53
2,333 % éch. 25/07/2029		316		313	0,29
Carlyle Euro CLO DAC					
2,078 % éch. 15/01/2031		600		585	0,53
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.					
2,548 % éch. 15/11/2031		300		291	0,27
Contego CLO BV					
2,148 % éch. 15/10/2030		300		293	0,27
Harvest CLO DAC					
2,018 % éch. 15/10/2031		400		389	0,35
2,138 % éch. 15/07/2031		300		290	0,26
2,228 % éch. 15/01/2032		500		484	0,44
Laurelin DAC					
2,176 % éch. 20/10/2031		400		388	0,35
Madison Park Euro Funding DAC					
2,128 % éch. 15/01/2032		400		387	0,35
Man GLG Euro CLO DAC					
2,058 % éch. 15/10/2030		375		367	0,33
2,248 % éch. 15/01/2030		572		559	0,51
NovaStar Mortgage Funding Trust					
5,094 % éch. 25/01/2036	$	347		319	0,29
OCP Euro CLO DAC					
2,382 % éch. 22/09/2034	€	400		389	0,35
Palmer Square European Loan Funding DAC					
3,993 % éch. 12/04/2032		300		298	0,27
Segovia European CLO DAC					
2,173 % éch. 18/01/2031		196		192	0,18
SLM Student Loan Trust					
2,596 % éch. 15/12/2033		139		133	0,12
Tikehau CLO DAC					
2,596 % éch. 04/08/2034		400		388	0,35
Toro European CLO DAC					
2,572 % éch. 15/02/2034		400		386	0,35
Voya Euro CLO DAC					
2,128 % éch. 15/10/2030		400		391	0,36
				11 312	10,28

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement autrichien			
0,850 % éch. 30/06/2120	€ 110	€ 43	0,04
Obligation internationale du gouvernement belge			
1,400 % éch. 22/06/2053	1 500	939	0,85
Obligation internationale du gouvernement croate			
1,500 % éch. 17/06/2031	400	332	0,30
Obligation internationale du gouvernement français			
0,500 % éch. 25/06/2044	2 000	1 156	1,05
0,500 % éch. 25/05/2072	3 850	1 436	1,31
0,750 % éch. 25/05/2052	24 400	12 887	11,71
1,500 % éch. 25/05/2050	1 100	744	0,68
1,750 % éch. 25/06/2039	2 850	2 313	2,10
1,750 % éch. 25/05/2066	670	453	0,41
2,000 % éch. 25/05/2048	6 450	4 986	4,53
3,250 % éch. 25/05/2045	7 200	7 103	6,46
4,000 % éch. 25/04/2055	2 300	2 589	2,35
4,000 % éch. 25/04/2060	4 600	5 285	4,80
4,500 % éch. 25/04/2041	3 150	3 642	3,31
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro			
0,400 % éch. 15/05/2030 (b)	233	204	0,19
1,300 % éch. 15/05/2028 (b)	842	815	0,74
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap			
3,250 % éch. 12/01/2043	€ 1 200	€ 1 114	1,01
Obligation internationale du gouvernement néerlandais			
0,000 % éch. 15/01/2038 (a)	2 500	1 629	1,48
0,000 % éch. 15/01/2052 (a)	3 900	1 871	1,70
2,750 % éch. 15/01/2047	3 650	3 645	3,31
4,000 % éch. 15/01/2037	1 400	1 565	1,42
Obligation internationale du gouvernement roumain			
2,125 % éch. 07/03/2028	100	84	0,08
3,750 % éch. 07/02/2034	100	75	0,07
Obligation internationale du gouvernement serbe			
2,050 % éch. 23/09/2036	200	113	0,10
Obligation internationale du gouvernement slovène			
0,000 % éch. 12/02/2031 (a)	700	517	0,47
1,500 % éch. 25/03/2035	2 400	1 829	1,66
Bon du Trésor britannique			
0,125 % éch. 30/01/2026	£ 1 900	1 933	1,76
		59 302	53,89
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BILLETS DE TRÉSORERIE			
Acciona Energia Financiacion Filiales S.A.			
2,078 % éch. 16/01/2023	€ 500	€ 499	0,45
SGS Nederland Holding BV			
2,109 % éch. 12/01/2023	500	500	0,46
Universal Music Group NV			
2,099 % échéance 13/02/2023	300	299	0,27
Total des Instruments à court terme		1 298	1,18
Total des Valeurs mobilières		**€ 103 959**	**94,47**

DESCRIPTION	ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT			
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (d)	51 900	4 940	4,49
Total des Fonds d'investissement		**€ 4 940**	**4,49**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BPS	(1,000) %	30/12/2022	02/01/2023	€ 1 500	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,625 % échéance 07/01/2028	€ (1 517)	€ 1 500	€ 1 500	1,36
Total des Contrats de mise en pension						**€ (1 517)**	**€ 1 500**	**€ 1 500**	**1,36**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Court	03/2023	21	€ 77	0,07
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	Court	03/2023	20	162	0,15
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Long	03/2023	53	(441)	(0,40)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	Long	03/2023	229	(5 793)	(5,27)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars	Long	03/2023	109	(995)	(0,91)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars	Long	03/2023	41	(45)	(0,04)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Long	03/2023	29	0	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Court	03/2023	10	7	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	37	(15)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Court	03/2023	15	(1)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	60	49	0,04
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Long	03/2023	6	(44)	(0,04)
				€ (7 039)	(6,40)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**€ (7 039)**	**(6,40)**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
British Telecommunications PLC	1,000 %	20/12/2028	€ 100	€ (2)	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION[2]

Indices/Tranches	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice iTraxx Europe Main 38 à 5 ans	(1,000) %	20/12/2027	€ 10 400	€ (95)	(0,09)

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000 %	15/03/2033	£ 1 000	€ (53)	(0,05)
À recevoir[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053	200	2	0,00
À recevoir[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250	15/03/2028	1 800	(14)	(0,01)
À payer[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,500	15/03/2025	100	0	0,00
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,707	16/12/2027	1 200	0	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	16/06/2029	¥ 147 000	19	0,02
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,050	15/12/2031	120 000	20	0,02
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,435	20/06/2029	103 000	11	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024	$ 9 300	(4)	0,00
À recevoir	ESTRON EUR composé-OIS à 3 mois	0,312	08/06/2026	€ 3 200	140	0,13
À payer	ESTRON EUR composé-OIS à 3 mois	0,546	28/02/2023	5 900	(21)	(0,02)
À payer	ESTRON EUR composé-OIS à 3 mois	0,566	08/03/2032	1 600	2	0,00
À recevoir	ESTRON EUR composé-OIS à 3 mois	1,000	07/07/2024	9 400	301	0,27
À recevoir	ESTRON EUR composé-OIS à 3 mois	2,250	20/09/2024	2 900	21	0,02
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,880	25/01/2052	$ 800	(218)	(0,20)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,000	04/11/2032	€ 3 600	(938)	(0,85)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,000	17/03/2036	700	200	0,18
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,195	04/11/2052	650	307	0,28
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,197	08/11/2052	1 300	531	0,48
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,450	15/12/2035	9 700	(3 209)	(2,92)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	300	(12)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	15/12/2040	10 800	(4 353)	(3,95)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2025	6 300	(11)	(0,01)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028	300	(1)	0,00
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053	15 000	449	0,41
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,700	15/03/2073	100	(20)	(0,02)
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	35 100	698	0,63
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	21/09/2037	11 100	(697)	(0,63)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	21/09/2042	12 700	(870)	(0,79)
À recevoir	CPTFEMU	3,340	15/08/2027	1 300	(9)	(0,01)
					€ (7 729)	(7,02)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**€ (7 826)**	**(7,11)**

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

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

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

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

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

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

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,000 %	15/03/2023	450	€ 42	€ 229	0,21
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,410	02/02/2023	4 100	18	0	0,00
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,720	23/02/2023	800	4	0	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,200	26/04/2023	1 400	14	1	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,710	25/01/2023	900	5	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,000	15/03/2023	250	23	127	0,12
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,428	31/01/2023	4 100	19	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,200	31/05/2023	3 900	44	4	0,00
							€ 169	€ 361	0,33

OPTIONS VENDUES

OPTIONS DE CHANGE

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	Option d'achat - EUR contre USD hors cote	$ 0,978	13/01/2023	553	€ (14)	€ (46)	(0,04)
	Option de vente - EUR contre USD hors cote	0,978	13/01/2023	553	(14)	0	0,00
					€ (28)	€ (46)	(0,04)

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,175 %	15/03/2023	1 350	€ (41)	€ (389)	(0,36)
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,558	02/02/2023	900	(18)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,635	30/05/2023	1 500	(47)	(12)	(0,01)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,635	30/05/2023	1 500	(47)	(86)	(0,08)
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À recevoir	4,290	17/01/2023	700	(30)	(36)	(0,03)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À payer	4,290	17/01/2023	700	(30)	(2)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,350	26/04/2023	800	(15)	(1)	0,00
GST	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À recevoir	4,670	10/01/2023	800	(33)	(68)	(0,06)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À payer	4,670	10/01/2023	800	(33)	0	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,785	25/01/2023	200	(5)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,175	15/03/2023	750	(22)	(216)	(0,20)
							€ (321)	€ (810)	(0,74)

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

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€	274	DKK	2 040	€ 0	€ 0	€ 0	0,00
	02/2023		114	AUD	176	0	(2)	(2)	0,00
	02/2023		543	NOK	5 640	0	(7)	(7)	(0,01)
	02/2023		645	$	680	0	(10)	(10)	(0,01)
	02/2023	£	82	€	92	0	0	0	0,00
	02/2023	¥	7 700		53	0	(1)	(1)	0,00
BPS	02/2023	€	35	¥	5 040	1	0	1	0,00
	02/2023	$	3 344	€	3 225	102	0	102	0,09
BRC	01/2023		20	CNH	138	0	0	0	0,00
	02/2023	€	154	$	165	0	0	0	0,00
	02/2023	$	1 016	€	964	14	0	14	0,01
CBK	01/2023	DKK	1 020		137	0	0	0	0,00
	02/2023	€	552	£	488	0	(3)	(3)	0,00
	02/2023		316	$	330	0	(8)	(8)	(0,01)
	02/2023	$	447	€	423	5	0	5	0,00
GLM	01/2023		21	CNH	143	0	0	0	0,00
JPM	01/2023	CNY	299	$	43	0	0	0	0,00
	01/2023	€	229	DKK	1 705	0	0	0	0,00
	01/2023	ILS	147	$	43	1	0	1	0,00
	02/2023	€	405	AUD	626	0	(8)	(8)	(0,01)
	02/2023		627	£	542	0	(18)	(18)	(0,02)
	02/2023		308	$	326	0	(3)	(3)	0,00
	02/2023	$	1 779	€	1 694	32	0	32	0,03
	03/2023	CNY	533	$	77	0	0	0	0,00
MBC	05/2023	CNH	1 128		168	3	0	3	0,00
MYI	02/2023	AUD	797	€	515	9	0	9	0,01
	02/2023	€	151	£	130	0	(4)	(4)	0,00
	02/2023		1 020	¥	146 419	23	0	23	0,02
	02/2023	$	249	€	238	5	0	5	0,01
RBC	02/2023		1 073		1 030	27	0	27	0,03
RYL	02/2023	¥	86 000		602	0	(11)	(11)	(0,01)
	02/2023	NOK	5 610		541	8	0	8	0,01
SCX	01/2023	DKK	41 419		5 571	1	0	1	0,00
	02/2023	€	3 115	£	2 738	0	(36)	(36)	(0,03)
	02/2023		131	¥	18 900	4	0	4	0,00
	02/2023	£	1 648	€	1 878	24	0	24	0,02
	03/2023	€	238	$	253	0	(2)	(2)	0,00
	03/2023	$	253	CNY	1 745	1	0	1	0,00
SSB	02/2023	£	11 662	€	13 288	167	0	167	0,15
UAG	02/2023	$	369		350	5	0	5	0,01
						€ 432	€ (113)	€ 319	0,29

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**€**	**(176)**	**(0,16)**
Total des Investissements	**€**	**95 358**	**86,65**
Autres actifs et passifs à court terme	**€**	**14 690**	**13,35**
Actif net	**€**	**110 048**	**100,00**

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

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

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

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

(d) Affilié au Fonds.

(e) Titre convertible conditionnel.

Un montant en numéraire de 4 192 € (31 décembre 2021 : 2 569 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un titre d'une juste valeur globale de 0 € (31 décembre 2021 : 276 €) et un montant en numéraire de 190 € (31 décembre 2021 : 0 €) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	€ 0	€ 103 959	€ 0	€ 103 959
Fonds d'investissement	4 940	0	0	4 940
Contrats de mise en pension	0	1 500	0	1 500
Instruments financiers dérivés[3]	(7 079)	(7 962)	0	(15 041)
Totaux	**€ (2 139)**	**€ 97 497**	**€ 0**	**€ 95 358**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	€ 0	€ 155 866	€ 0	€ 155 866
Fonds d'investissement	407	0	0	407
Contrats de mise en pension	0	1 236	0	1 236
Instruments financiers dérivés[3]	(2 521)	(1 841)	0	(4 362)
Totaux	**€ (2 114)**	**€ 155 261**	**€ 0**	**€ 153 147**

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

[2] Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	€ (20)	€ 0	€ (20)	€ (3)	€ 0	€ (3)
BPS	(57)	190	133	(48)	0	(48)
BRC	(84)	0	(84)	(8)	0	(8)
CBK	(44)	0	(44)	(38)	0	(38)
DUB	S/O	S/O	S/O	1	0	1
GLM	(46)	0	(46)	(63)	0	(63)
GSC	S/O	S/O	S/O	(1)	0	(1)
GST	(68)	0	(68)	S/O	S/O	S/O
HUS	S/O	S/O	S/O	(95)	0	(95)
JPM	(85)	0	(85)	(15)	0	(15)
MBC	3	0	3	S/O	S/O	S/O
MYC	4	0	4	(17)	(120)	(137)
MYI	33	0	33	3	0	3
RBC	27	0	27	S/O	S/O	S/O
RYL	(3)	0	(3)	(350)	276	(74)
SCX	(8)	0	(8)	1	0	1
SSB	167	0	167	S/O	S/O	S/O
UAG	5	0	5	64	0	64

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	87,44	95,50
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	7,03	1,55
Fonds d'investissement	4,49	0,25
Contrats de mise en pension	1,36	0,77
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(6,40)	(1,57)
Instruments financiers dérivés compensés	(7,11)	(0,79)
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,16)	(0,35)

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Obligations et billets privés	7,89	20,96
Agences du gouvernement américain	5,28	0,50
Obligations du Trésor américain	3,51	2,54
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	12,44	8,65
Titres adossés à des actifs	10,28	12,35
Émissions souveraines	53,89	51,74
Instruments à court terme	1,18	0,31
Fonds d'investissement	4,49	0,25
Contrats de mise en pension	1,36	0,77
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(6,40)	(1,57)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection	(0,09)	S/O
Swaps de taux d'intérêt	(7,02)	(0,79)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,33	0,28
Options vendues		
Options de change	(0,04)	(0,01)
Swaptions de taux d'intérêt	(0,74)	(0,55)
Options sur titres	S/O	0,00
Contrats de change à terme	0,29	(0,07)
Autres actifs et passifs à court terme	13,35	4,64
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Euro Short-Term Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
BANQUE ET FINANCE					
AMCO - Asset Management Co. SpA					
1,500 % éch. 17/07/2023	€	4 200	€	4 160	1,18
American Tower Corp.					
1,375 % éch. 04/04/2025		1 100		1 038	0,29
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.					
0,250 % éch. 17/03/2025		3 400		3 172	0,90
AyT Cedulas Cajas Fondo de Titulizacion de Activos					
3,750 % éch. 30/06/2025		1 100		1 102	0,31
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA					
2,875 % éch. 16/07/2024		2 500		2 464	0,70
Banco de Sabadell S.A.					
1,625 % éch. 07/03/2024		1 800		1 752	0,50
Banco Santander S.A.					
2,552 % éch. 21/11/2024		500		501	0,14
Bank of America Corp.					
2,863 % éch. 24/08/2025		3 300		3 288	0,93
Bank of China Ltd.					
3,772 % éch. 10/08/2023	£	5 000		5 620	1,59
Bank of Ireland Group PLC					
1,375 % éch. 29/08/2023	€	1 500		1 484	0,42
Bank of Nova Scotia					
3,050 % éch. 31/10/2024		1 800		1 787	0,51
Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.					
3,508 % éch. 26/01/2025	£	1 600		1 793	0,51
Barclays PLC					
3,125 % éch. 17/01/2024		500		551	0,16
BNP Paribas S.A.					
0,500 % éch. 15/07/2025	€	1 200		1 140	0,32
BNZ International Funding Ltd.					
0,625 % éch. 03/07/2025		6 300		5 871	1,66
CaixaBank S.A.					
0,375 % éch. 03/02/2025		2 800		2 615	0,74
Caja Rural de Navarra SCC					
0,625 % éch. 01/12/2023		3 000		2 929	0,83
Cedulas TDA Fondo de Titulizacion de Activos					
3,875 % éch. 23/05/2025		2 800		2 819	0,80
Citigroup, Inc.					
5,586 % éch. 24/05/2025	$	1 700		1 589	0,45
Clydesdale Bank PLC					
4,062 % éch. 22/03/2026	£	1 900		2 145	0,61
Commonwealth Bank of Australia					
4,928 % éch. 09/12/2026	$	2 600		2 439	0,69
Credit Suisse AG					
3,184 % éch. 31/05/2024	€	2 700		2 617	0,74
6,500 % éch. 08/08/2023 (c)	$	800		728	0,21
Dell Bank International DAC					
1,625 % éch. 24/06/2024	€	2 500		2 413	0,68
Deutsche Bank AG					
1,000 % éch. 19/11/2025		1 400		1 308	0,37
2,625 % éch. 16/12/2024	£	1 800		1 886	0,53
Deutsche Pfandbriefbank AG					
3,994 % éch. 26/04/2024		1 500		1 698	0,48
4,442 % éch. 29/09/2023		1 000		1 131	0,32
Dexia Credit Local S.A.					
0,250 % éch. 01/06/2023	€	3 800		3 766	1,07
Digital Euro Finco LLC					
2,625 % éch. 15/04/2024		800		777	0,22
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial					
0,250 % éch. 25/04/2023		1 500		1 491	0,42
Fédération des Caisses Desjardins du Québec					
2,875 % éch. 28/11/2024		1 200		1 187	0,34
Ford Motor Credit Co. LLC					
1,514 % éch. 17/02/2023		1 500		1 492	0,42
General Motors Financial Co., Inc.					
5,360 % éch. 17/11/2023	$	600		561	0,16
Goldman Sachs Group, Inc.					
0,010 % éch. 30/04/2024	€	1 500		1 483	0,42
2,605 % éch. 30/04/2024		1 900		1 900	0,54
Great-West Lifeco, Inc.					
2,500 % éch. 18/04/2023		1 200		1 199	0,34
Hamburg Commercial Bank AG					
1,375 % éch. 27/05/2025	€	1 500	€	1 428	0,40
6,250 % éch. 18/11/2024		2 000		2 028	0,57
HSBC Holdings PLC					
1,500 % éch. 04/12/2024		1 000		983	0,28
6,500 % éch. 20/05/2024	£	300		343	0,10
ING Bank Australia Ltd.					
3,890 % éch. 26/05/2025	AUD	1 200		761	0,22
4,700 % éch. 08/12/2025		2 400		1 516	0,43
ING Groep NV					
0,100 % éch. 03/09/2025	€	1 200		1 123	0,32
Land Securities Capital Markets PLC					
1,974 % éch. 08/02/2026	£	1 500		1 634	0,46
Landesbank Baden-Wuerttemberg					
2,000 % éch. 24/02/2025	$	1 200		1 056	0,30
LeasePlan Corp. NV					
0,125 % éch. 13/09/2023	€	2 200		2 147	0,61
1,000 % éch. 02/05/2023		1 200		1 192	0,34
Liberty Mutual Finance Europe DAC					
1,750 % éch. 27/03/2024		3 000		2 923	0,83
Lloyds Banking Group PLC					
2,250 % éch. 16/10/2024	£	1 300		1 392	0,39
3,500 % éch. 01/04/2026	€	1 800		1 772	0,50
Logicor Financing SARL					
0,750 % éch. 15/07/2024		1 600		1 470	0,42
Mitsubishi HC Capital UK PLC					
0,250 % éch. 03/02/2025		1 000		924	0,26
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.					
2,264 % éch. 14/06/2025		1 600		1 558	0,44
3,273 % éch. 19/09/2025		1 700		1 674	0,47
Mizuho Financial Group, Inc.					
0,523 % éch. 10/06/2024		1 400		1 342	0,38
Morgan Stanley					
0,637 % éch. 26/07/2024		2 600		2 560	0,72
Nationwide Building Society					
0,250 % éch. 22/07/2025		1 800		1 659	0,47
1,000 % éch. 24/01/2023	£	1 100		1 238	0,35
NatWest Group PLC					
0,750 % éch. 15/11/2025	€	1 500		1 404	0,40
2,000 % éch. 04/03/2025		1 900		1 854	0,52
Nomura Holdings, Inc.					
2,648 % éch. 16/01/2025	$	2 100		1 859	0,53
Permanent TSB Group Holdings PLC					
5,250 % éch. 30/06/2025	€	900		868	0,25
Sagax AB					
2,000 % éch. 17/01/2024		700		671	0,19
Santander UK Group Holdings PLC					
2,975 % éch. 27/03/2024		2 800		2 801	0,79
Société Générale S.A.					
1,125 % éch. 23/01/2025		1 300		1 232	0,35
1,250 % éch. 15/02/2024		2 100		2 050	0,58
Standard Chartered PLC					
1,214 % éch. 23/03/2025 (d)	$	1 900		1 681	0,48
Sumitomo Mitsui Banking Corp.					
0,550 % éch. 06/11/2023	€	7 300		7 129	2,02
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.					
2,550 % éch. 10/03/2025	$	200		177	0,05
4,800 % éch. 15/09/2025		400		370	0,10
Toronto-Dominion Bank					
1,707 % éch. 28/07/2025	€	3 100		2 971	0,84
3,405 % éch. 22/04/2025	£	1 900		2 137	0,61
TP ICAP Finance PLC					
5,250 % éch. 26/01/2024		1 500		1 652	0,47
UBS AG					
4,565 % éch. 09/08/2024	$	1 400		1 303	0,37
UBS Group AG					
1,000 % éch. 21/03/2025	€	2 100		2 021	0,57
Virgin Money UK PLC					
0,375 % éch. 27/05/2024		3 400		3 337	0,94
Wells Fargo & Co.					
1,338 % éch. 04/05/2025		2 470		2 385	0,68
Yorkshire Building Society					
0,125 % éch. 08/05/2024		3 100		2 966	0,84
0,375 % éch. 11/04/2023		2 000		1 990	0,56
3,000 % éch. 18/04/2025	£	400		433	0,12
				151 910	43,02
INDUSTRIE					
American Medical Systems Europe BV					
0,750 % éch. 08/03/2025	€	300	€	282	0,08
ArcelorMittal S.A.					
1,000 % éch. 19/05/2023		1 100		1 092	0,31
Bacardi Ltd.					
2,750 % éch. 03/07/2023		2 192		2 187	0,62
Barry Callebaut Services NV					
2,375 % éch. 24/05/2024		400		395	0,11
Bayer AG					
0,050 % éch. 12/01/2025		1 200		1 119	0,32
Becton Dickinson and Co.					
0,000 % éch. 13/08/2023 (a)		3 000		2 946	0,83
Bureau Veritas S.A.					
1,250 % éch. 07/09/2023		3 300		3 291	0,93
Coloplast Finance BV					
2,552 % éch. 19/05/2024		1 800		1 809	0,51
Daimler Truck International Finance BV					
1,250 % éch. 06/04/2025		1 300		1 231	0,35
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide					
1,625 % éch. 09/07/2024		3 200		3 098	0,88
Informa PLC					
1,500 % éch. 05/07/2023		1 122		1 113	0,31
InterContinental Hotels Group PLC					
1,625 % éch. 08/10/2024		1 200		1 150	0,33
Nissan Motor Co. Ltd.					
1,940 % éch. 15/09/2023		2 900		2 862	0,81
Ryanair DAC					
1,125 % éch. 15/08/2023		2 500		2 472	0,70
Schaeffler AG					
1,875 % éch. 26/03/2024		3 000		2 936	0,83
SEB S.A.					
1,500 % éch. 31/05/2024		3 000		2 869	0,81
Ubisoft Entertainment S.A.					
1,289 % éch. 30/01/2023		2 900		2 893	0,82
Warnermedia Holdings, Inc.					
6,092 % éch. 15/03/2024	$	400		374	0,11
Worldline S.A.					
1,625 % éch. 13/09/2024	€	1 500		1 445	0,41
ZF Finance GmbH					
3,000 % éch. 21/09/2025		1 300		1 201	0,34
ZF North America Capital, Inc.					
2,750 % éch. 27/04/2023		800		797	0,23
				37 562	10,64
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS					
CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.					
0,375 % éch. 17/10/2023		1 900		1 857	0,53
National Grid Electricity Distribution PLC					
3,625 % éch. 06/11/2023	£	2 200		2 454	0,70
National Grid North America, Inc.					
1,000 % éch. 12/07/2024	€	800		768	0,22
SSE PLC					
1,250 % éch. 16/04/2025		1 100		1 041	0,29
Teollisuuden Voima Oyj					
2,125 % éch. 04/02/2025		1 900		1 807	0,51
Wintershall Dea Finance BV					
0,452 % éch. 25/09/2023		1 600		1 562	0,44
				9 489	2,69
Total des Obligations et billets privés				198 961	56,35
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN					
Freddie Mac					
0,650 % éch. 27/10/2025	$	3 900		3 271	0,93
0,800 % éch. 28/10/2026		4 200		3 431	0,97
				6 702	1,90
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX					
Atlas Funding PLC					
3,894 % éch. 25/07/2058	£	1 226		1 371	0,39
Avon Finance PLC					
4,331 % éch. 20/09/2048		3 476		3 844	1,09

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Barley Hill PLC					
4,352 % éch. 27/08/2058	£	615	€	686	0,19
Canterbury Finance PLC					
4,335 % éch. 16/05/2057		284		320	0,09
4,595 % éch. 16/05/2056		579		652	0,18
Cheshire PLC					
4,171 % éch. 20/08/2045		799		885	0,25
Domi BV					
2,642 % éch. 15/11/2052	€	963		956	0,27
2,896 % éch. 15/06/2051		136		135	0,04
Dutch Property Finance BV					
2,278 % éch. 28/04/2059		707		696	0,20
2,328 % éch. 28/10/2059		1 315		1 295	0,37
Eurosail PLC					
4,461 % éch. 13/06/2045	£	787		876	0,25
Fingal Securities RMBS DAC					
2,578 % éch. 28/07/2055	€	1 688		1 684	0,48
Formentera Issuer PLC					
3,844 % éch. 28/07/2047	£	1 376		1 529	0,43
Hops Hill PLC					
4,382 % éch. 27/05/2054		332		371	0,10
4,732 % éch. 27/11/2054		1 979		2 178	0,62
Jubilee Place BV					
2,228 % éch. 17/01/2059	€	2 979		2 927	0,83
Kinbane DAC					
2,744 % éch. 25/09/2062		1 383		1 321	0,37
Lanebrook Mortgage Transaction PLC					
4,487 % éch. 12/06/2057	£	648		726	0,21
Mansard Mortgages PLC					
4,172 % éch. 15/12/2049		625		678	0,19
Polaris PLC					
4,732 % éch. 23/05/2059		1 221		1 360	0,39
Precise Mortgage Funding PLC					
4,265 % éch. 16/10/2056		44		49	0,01
Residential Mortgage Securities PLC					
4,681 % éch. 20/06/2070		66		74	0,02
Shamrock Residential DAC					
2,744 % éch. 24/12/2059	€	2 273		2 238	0,63
Stratton Mortgage Funding PLC					
3,826 % éch. 20/07/2060	£	2 954		3 301	0,93
4,087 % éch. 12/12/2043		380		421	0,12
4,292 % éch. 25/09/2051		2 471		2 750	0,78
Towd Point Mortgage Funding PLC					
3,596 % éch. 20/10/2051		1 700		1 871	0,53
3,826 % éch. 20/07/2045		336		374	0,11
4,071 % éch. 20/10/2051		965		1 081	0,31
4,190 % éch. 20/02/2045		2 359		2 623	0,74
4,471 % éch. 20/02/2054		1 628		1 828	0,52
Tower Bridge Funding PLC					
4,801 % éch. 20/09/2063		1 017		1 145	0,32
Trinity Square PLC					
3,729 % éch. 15/07/2059		4 752		5 294	1,50
Tudor Rose Mortgages					
4,031 % éch. 20/06/2048		1 988		2 210	0,63
Twin Bridges PLC					
4,386 % éch. 12/09/2050		474		533	0,15
				50 282	14,24

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS					
Accunia European CLO DAC					
2,308 % éch. 15/10/2030	€	363	€	357	0,10
2,326 % éch. 20/01/2031		3 100		3 009	0,85
Avoca CLO DAC					
2,129 % éch. 12/01/2031		1 900		1 856	0,53
2,268 % éch. 15/04/2033		1 730		1 673	0,47
Bain Capital Euro CLO DAC					
2,196 % éch. 20/01/2032		3 800		3 702	1,05
Black Diamond CLO DAC					
2,316 % éch. 20/01/2032		193		189	0,05
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC					
2,028 % éch. 15/07/2030		783		764	0,22
BNPP AM Euro CLO DAC					
1,978 % éch. 15/04/2031		200		194	0,05
Cairn CLO DAC					
2,275 % éch. 31/01/2030		1 841		1 804	0,51
CVC Cordatus Loan Fund DAC					
2,112 % éch. 21/07/2030		565		554	0,16
Driver Australia Six Trust					
3,910 % éch. 21/12/2027	AUD	109		69	0,02
Euro-Galaxy CLO DAC					
1,958 % éch. 11/04/2031	€	600		586	0,17
2,122 % éch. 24/04/2034		1 000		970	0,27
Harvest CLO DAC					
2,775 % éch. 26/06/2030		1 544		1 510	0,43
Jubilee CLO DAC					
1,988 % éch. 15/04/2030		100		98	0,03
2,128 % éch. 12/07/2028		25		25	0,01
Man GLG Euro CLO DAC					
2,058 % éch. 15/10/2030		986		963	0,27
2,248 % éch. 15/01/2030		229		224	0,06
Oak Hill European Credit Partners Ltd.					
2,356 % éch. 22/07/2030		156		155	0,04
OCP Euro CLO DAC					
2,198 % éch. 15/01/2032		790		776	0,22
OZLME DAC					
2,613 % éch. 24/08/2030		1 585		1 536	0,44
Palmer Square European Loan Funding DAC					
2,098 % éch. 15/10/2031		587		569	0,16
2,108 % éch. 15/07/2031		820		798	0,23
2,158 % éch. 15/04/2031		256		249	0,07
Toro European CLO DAC					
2,118 % éch. 15/10/2030		500		489	0,14
Willow Park CLO DAC					
2,218 % éch. 15/01/2031		1 200		1 173	0,33
				24 292	6,88
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Development Bank of Japan, Inc.					
0,010 % éch. 15/10/2024		2 600		2 446	0,69
Korea Housing Finance Corp.					
0,010 % éch. 05/02/2025		3 100		2 873	0,81
0,723 % éch. 22/03/2025		5 700		5 340	1,51
Obligation internationale du gouvernement polonais					
0,000 % éch. 07/07/2023 (a)		3 100		3 061	0,87
				13 720	3,88

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
INSTRUMENTS À COURT TERME					
BILLETS DE TRÉSORERIE					
Acciona Energia Financiacion Filiales S.A.					
2,078 % éch. 16/01/2023	€	1 700	€	1 698	0,48
Fiserv, Inc.					
1,673 % éch. 05/01/2023		600		600	0,17
Nomura Bank International PLC					
2,078 % éch. 28/02/2023		1 500		1 495	0,42
SGS Nederland Holding BV					
2,099 % éch. 30/01/2023		1 500		1 497	0,42
2,210 % éch. 19/01/2023		900		899	0,26
				6 189	1,75
BONS DU TRÉSOR FRANÇAIS					
1,600 % éch. 22/03/2023 (a)(b)		400		398	0,11
1,612 % éch. 22/03/2023 (a)(b)		400		399	0,12
1,625 % éch. 22/03/2023 (a)(b)		400		399	0,11
1,784 % éch. 15/03/2023 (a)(b)		200		199	0,06
				1 395	0,40
BONS DU TRÉSOR ALLEMAND					
1,658 % éch. 22/03/2023 (a)(b)		2 900		2 890	0,82
BONS DU TRÉSOR HONGROIS					
18,250 % éch. 03/01/2023 (a)(b)	HUF	642 000		1 603	0,45
BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN					
0,022 % éch. 04/01/2023 (a)(b)	ILS	4 000		1 062	0,30
0,851 % éch. 02/03/2023 (a)(b)		324		86	0,03
0,913 % éch. 05/04/2023 (a)(b)		1 776		467	0,13
1,203 % éch. 02/03/2023 (a)(b)		5 800		1 531	0,43
				3 146	0,89
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS					
(0,209) % éch. 06/01/2023 (a)(b)		¥1 333 000		9 466	2,68
(0,191) % éch. 06/01/2023 (a)(b)		497 000		3 529	1,00
(0,159) % éch. 23/01/2023 (a)(b)		1 200 000		8 523	2,42
				21 518	6,10
Total des Instruments à court terme				36 741	10,41
Total des Valeurs mobilières			**€**	**330 698**	**93,66**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BPS	(1,000) %	30/12/2022	02/01/2023	€ 14 100	BNG Bank NV 0,875 % échéance 24/10/2036	€ (14 286)	€ 14 100	€ 14 099	3,99
Total des Contrats de mise en pension						**€ (14 286)**	**€ 14 100**	**€ 14 099**	**3,99**

(1) Comprend les intérêts courus.

Tableau des investissements Fonds Euro Short-Term Fund (suite)

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Court	03/2023	567	€ 1 923	0,54
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars	Court	03/2023	404	551	0,16
				€ 2 474	0,70
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**€ 2 474**	**0,70**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AT&T, Inc.	1,000 %	20/06/2024	$ 1 000	€ 1	0,00

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	ESTRON EUR composé-OIS à 3 mois	1,250 %	13/03/2023	€ 370 000	€ (87)	(0,02)
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2025	29 700	(427)	(0,12)
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028	55 900	(1 088)	(0,31)
					€ (1 602)	(0,45)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**€ (1 601)**	**(0,45)**

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

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

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

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

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

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	02/2023	AUD	280	€	181	€ 3	€ 0	€ 3	0,00
	02/2023	¥	12 600		87	0	(2)	(2)	0,00
	03/2023	ILS	5 752	$	1 695	56	0	56	0,02
BPS	01/2023	HUF	231 164		604	0	(11)	(11)	0,00
	02/2023	€	79	¥	11 422	2	0	2	0,00
BRC	01/2023	£	339	€	392	10	0	10	0,00
	01/2023	HUF	352 829	$	920	0	(19)	(19)	(0,01)
	01/2023	$	170	€	159	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	€	3 143	£	2 714	0	(85)	(85)	(0,02)
	01/2023	ILS	3 999	$	1 269	127	0	127	0,04
	04/2023		1 763		540	35	0	35	0,01
JPM	01/2023		263		77	2	0	2	0,00
	02/2023	AUD	3 372	€	2 154	14	0	14	0,00
	02/2023	€	556	¥	80 200	15	0	15	0,00
MBC	01/2023		8 514	$	9 032	0	(55)	(55)	(0,02)
	01/2023	¥	1 200 000	€	8 354	0	(177)	(177)	(0,05)
	01/2023	$	35 054		33 428	597	0	597	0,17
	02/2023	AUD	5		3	0	0	0	0,00
	03/2023	ILS	322	$	98	6	0	6	0,00
MYI	01/2023	€	1 679	£	1 449	0	(46)	(46)	(0,01)
	01/2023		1 808	$	1 893	0	(35)	(35)	(0,01)
	01/2023	$	1 841	€	1 746	21	0	21	0,01
	02/2023	€	2 311	¥	331 808	52	0	52	0,01
	02/2023	¥	70 200	€	483	0	(17)	(17)	0,00
RBC	01/2023		1 830 000		12 805	0	(191)	(191)	(0,05)
	02/2023		79 300		565	1	0	1	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
SCX	01/2023	€ 1 397	£ 1 221	€ 0	€ (21)	€ (21)	(0,01)
	01/2023	£ 65 278	€ 75 547	1 993	0	1 993	0,56
UAG	01/2023	€ 1 865	£ 1 613	0	(48)	(48)	(0,01)
	01/2023	HUF 55 579	$ 145	0	(3)	(3)	0,00
				€ 2 934	€ (710)	€ 2 224	0,63
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						**€ 2 224**	**0,63**
Total des Investissements						**€ 347 895**	**98,53**
Autres actifs et passifs à court terme						**€ 5 200**	**1,47**
Actif net						**€ 353 095**	**100,00**

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

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

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(c) Titre convertible conditionnel.

(d) Titres sujets à restrictions :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Standard Chartered PLC	1,214 %	23/03/2025	21/10/2022 - 24/10/2022	€ 1 793	€ 1 681	0,48

Un montant en numéraire de 6 376 € (31 décembre 2021 : 2 551 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 20 € (31 décembre 2021 : 2 340 € a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	€ 0	€ 330 698	€ 0	€ 330 698
Contrats de mise en pension	0	14 100	0	14 100
Instruments financiers dérivés[3]	2 474	623	0	3 097
Totaux	**€ 2 474**	**€ 345 421**	**€ 0**	**€ 347 895**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	€ 0	€ 595 961	€ 0	€ 595 961
Contrats de mise en pension	0	26 537	0	26 537
Instruments financiers dérivés[3]	328	(957)	0	(629)
Totaux	**€ 328**	**€ 621 541**	**€ 0**	**€ 621 869**

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

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

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	€ 57	€ 0	€ 57	€ (5)	€ 0	€ (5)
BPS	(9)	0	(9)	(165)	240	75
BRC	(9)	0	(9)	327	0	327
CBK	77	0	77	(355)	330	(25)
GLM	S/O	S/O	S/O	20	0	20
HUS	S/O	S/O	S/O	93	0	93

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
JPM	€ 31	€ 0	€ 31	€ (32)	€ 0	€ (32)
MBC	371	(230)	141	S/O	S/O	S/O
MYI	(25)	0	(25)	S/O	S/O	S/O
RBC	(190)	20	(170)	S/O	S/O	S/O
RYL	S/O	S/O	S/O	0	840	840
SCX	1 972	(1 890)	82	(908)	930	22
SOG	S/O	S/O	S/O	4	0	4
UAG	(51)	0	(51)	37	0	37

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	82,88	85,00
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	10,78	9,62
Contrats de mise en pension	3,99	4,21
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,70	0,05
Instruments financiers dérivés compensés	(0,45)	0,01
Instruments financiers dérivés hors cote	0,63	(0,16)

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Obligations et billets privés	56,35	56,96
Agences du gouvernement américain	1,90	1,10
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	14,24	8,63
Titres adossés à des actifs	6,88	10,12
Émissions souveraines	3,88	6,66
Instruments à court terme	10,41	11,15
Contrats de mise en pension	3,99	4,21
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,70	0,05
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(0,45)	0,01
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	S/O	0,00
Contrats de change à terme	0,63	(0,16)
Autres actifs et passifs à court terme	1,47	1,27
Actif net	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
ÎLES CAÏMANS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Kaisa Group Holdings Ltd.				
9,750 % éch. 28/09/2023 ^	$	300	€ 40	0,02
CHINE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Yango Justice International Ltd.				
8,250 % éch. 25/11/2023 ^		300	10	0,01
RÉPUBLIQUE TCHÈQUE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
EP Infrastructure A/S				
1,659 % éch. 26/04/2024	€	700	623	0,36
1,698 % éch. 30/07/2026		1 900	1 518	0,87
Total République tchèque			2 141	1,23
DANEMARK				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
DKT Finance ApS				
7,000 % éch. 17/06/2023		1 000	997	0,57
Norican A/S				
4,500 % éch. 15/05/2023		1 100	1 041	0,60
TDC Net A/S				
5,056 % éch. 31/05/2028		300	295	0,17
Total Danemark			2 333	1,34
FRANCE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Accor S.A.				
2,375 % éch. 29/11/2028		900	772	0,44
2,625 % éch. 30/01/2025 (d)		500	415	0,24
4,375 % éch. 30/01/2024 (d)		500	473	0,27
Altice France S.A.				
2,125 % éch. 15/02/2025		1 400	1 242	0,71
2,500 % éch. 15/01/2025		800	721	0,41
BNP Paribas S.A.				
7,750 % éch. 16/08/2029 (d)(f)	$	700	649	0,37
CAB SELAS				
3,375 % éch. 01/02/2028	€	1 100	887	0,51
Chrome Bidco SASU				
3,500 % éch. 31/05/2028		300	253	0,15
Électricité de France S.A.				
2,625 % éch. 01/12/2027 (d)		1 000	783	0,45
2,875 % éch. 15/12/2026 (d)		1 800	1 481	0,85
3,375 % éch. 15/06/2030 (d)		1 000	729	0,42
4,000 % éch. 04/07/2024 (d)		700	658	0,38
5,625 % éch. 22/01/2024 (d)	$	800	710	0,41
Elior Group S.A.				
3,750 % éch. 15/07/2026	€	1 100	933	0,54
Faurecia SE				
2,750 % éch. 15/02/2027		2 400	2 034	1,17
iliad S.A.				
5,375 % éch. 14/06/2027		2 700	2 689	1,54
Loxam S.A.S.				
2,875 % éch. 15/04/2026		500	447	0,26
3,250 % éch. 14/01/2025		700	669	0,38
4,500 % éch. 15/02/2027		300	275	0,16
4,500 % éch. 15/04/2027		400	338	0,19
Renault S.A.				
1,125 % éch. 04/10/2027		2 000	1 613	0,93
2,500 % éch. 02/06/2027		600	523	0,30
Rexel S.A.				
2,125 % éch. 15/12/2028		200	174	0,10
Valeo				
5,375 % éch. 28/05/2027		300	293	0,17
Vallourec S.A.				
8,500 % éch. 30/06/2026		800	787	0,45
Verallia S.A.				
1,875 % éch. 10/11/2031		800	626	0,36
Total France			21 174	12,16

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ALLEMAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Cheplapharm Arzneimittel GmbH				
3,500 % éch. 11/02/2027	€	900	€ 791	0,45
4,375 % éch. 15/01/2028		100	88	0,05
Clearstream Banking AG				
0,000 % éch. 01/12/2025 (b)		100	91	0,05
Commerzbank AG				
4,000 % éch. 05/12/2030		1 300	1 225	0,70
CT Investment GmbH				
5,500 % éch. 15/04/2026		600	534	0,31
Ctec GmbH				
5,250 % éch. 15/02/2030		200	167	0,10
Deutsche Bank AG				
5,625 % éch. 19/05/2031		500	489	0,28
10,000 % éch. 01/12/2027 (d)(f)		400	415	0,24
IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % en numéraire ou 4,625 % de rémunération en nature)				
3,875 % éch. 15/05/2027 (a)		1 200	1 018	0,58
IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % en numéraire ou 7,125 % de rémunération en nature)				
6,375 % éch. 15/05/2029 (a)	$	1 400	1 111	0,64
Nidda Healthcare Holding GmbH				
7,500 % éch. 21/08/2026	€	2 200	2 108	1,21
Techem Verwaltungsgesellschaft mbH				
2,000 % éch. 15/07/2025		1 400	1 291	0,74
ZF Finance GmbH				
2,250 % éch. 03/05/2028		500	392	0,23
2,750 % éch. 25/05/2027		2 800	2 366	1,36
Total Allemagne			12 086	6,94
IRLANDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Bank of Ireland Group PLC				
7,500 % éch. 19/05/2025 (d)(f)		1 000	974	0,56
Permanent TSB Group Holdings PLC				
3,000 % éch. 19/08/2031		1 000	819	0,47
Total Irlande			1 793	1,03
ÎLE DE MAN				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
GVC Holdings PLC				
4,398 % éch. 29/03/2024		1 800	1 786	1,03
ITALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Atlantia SpA				
1,875 % éch. 12/02/2028		4 900	4 085	2,35
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
1,875 % éch. 09/01/2026		900	774	0,45
5,375 % éch. 18/01/2028		600	485	0,28
10,500 % éch. 23/07/2029		100	93	0,05
Castor SpA				
6,000 % éch. 15/02/2029		600	538	0,31
FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA				
5,625 % éch. 01/08/2027		900	721	0,41
Inter Media and Communication SpA				
6,750 % éch. 09/02/2027		2 000	1 901	1,09
Intesa Sanpaolo SpA				
6,375 % éch. 30/03/2028 (d)(f)		400	344	0,20
8,248 % éch. 21/11/2033	$	2 100	2 002	1,15
Nexi SpA				
2,125 % éch. 30/04/2029	€	1 900	1 547	0,89
Telecom Italia SpA				
1,625 % éch. 18/01/2029		600	460	0,26
UniCredit SpA				
6,625 % éch. 03/06/2023 (d)(f)		600	582	0,33
7,500 % éch. 03/06/2026 (d)(f)		700	682	0,39
Total Italie			14 214	8,16
JAPON				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
SoftBank Group Corp.				
3,375 % éch. 06/07/2029		400	296	0,17
4,000 % éch. 19/09/2029		700	537	0,31

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
5,000 % éch. 15/04/2028	€	1 000	€ 853	0,49
Total Japon			1 686	0,97
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Adient Global Holdings Ltd.				
3,500 % éch. 15/08/2024		1 900	1 828	1,05
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP				
5,844 % éch. 05/11/2031 (d)	£	250	289	0,17
HSBC Capital Funding Dollar LP				
10,176 % éch. 30/06/2030 (d)	$	100	113	0,06
Total Jersey, îles Anglo-Normandes			2 230	1,28
LUXEMBOURG				
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES				
Corestate Capital Holding S.A.				
1,375 % éch. 28/11/2049 ^	€	200	37	0,02
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Albion Financing SARL				
5,250 % éch. 15/10/2026		900	790	0,45
Altice Financing S.A.				
3,000 % éch. 15/01/2028		1 200	951	0,55
Altice France Holding S.A.				
8,000 % éch. 15/05/2027		550	408	0,23
ARD Finance S.A. (5,000 % en numéraire ou 5,750 % de rémunération en nature)				
5,000 % éch. 30/06/2027 (a)		600	406	0,23
ARD Finance S.A. (6,500 % en numéraire ou 7,250 % de rémunération en nature)				
6,500 % éch. 30/06/2027 (a)	$	700	457	0,26
Cidron Aida Finco SARL				
5,000 % éch. 01/04/2028	€	400	345	0,20
6,250 % éch. 01/04/2028	£	500	461	0,26
Cirsa Finance International SARL				
4,500 % éch. 15/03/2027	€	500	433	0,25
4,750 % éch. 22/05/2025		800	759	0,44
Corestate Capital Holding S.A.				
3,500 % éch. 15/04/2023 ^		300	47	0,03
CPI Property Group S.A.				
4,875 % éch. 16/07/2025 (d)		1 000	509	0,29
4,875 % éch. 18/08/2026 (d)		400	203	0,12
InPost S.A.				
2,250 % éch. 15/07/2027		900	747	0,43
LHMC Finco 2 SARL (7,250 % en numéraire ou 8,000 % de rémunération en nature)				
7,250 % éch. 02/10/2025 (a)		400	347	0,20
Loarre Investments SARL				
6,500 % éch. 15/05/2029		900	835	0,48
Logicor Financing SARL				
0,750 % éch. 15/07/2024		300	276	0,16
2,250 % éch. 13/05/2025		1 500	1 373	0,79
PLT Finance SARL				
4,625 % éch. 05/01/2026		1 000	945	0,54
Rossini SARL				
6,750 % éch. 30/10/2025		1 000	994	0,57
Signa Development Finance SCS				
5,500 % éch. 23/07/2026		600	376	0,22
Summer BC Holdco SARL				
5,750 % éch. 31/10/2026		2 350	2 012	1,15
Telecom Italia Capital S.A.				
6,375 % éch. 15/11/2033	$	700	538	0,31
Trafigura Funding S.A.				
3,875 % éch. 02/02/2026	€	800	760	0,44
			14 972	8,60
Total Luxembourg			15 009	8,62
MULTINATIONALES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Clarios Global LP				
4,375 % éch. 15/05/2026		1 000	927	0,53
PAYS-BAS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Axalta Coating Systems Dutch Holding BV				
3,750 % éch. 15/01/2025		900	865	0,50

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

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CTP NV				
0,500 % éch. 21/06/2025	€	1 000	€ 840	0,48
Dufry One BV				
2,000 % éch. 15/02/2027		1 300	1 068	0,61
3,625 % éch. 15/04/2026	CHF	1 300	1 159	0,67
Energizer Gamma Acquisition BV				
3,500 % éch. 30/06/2029	€	1 000	804	0,46
Sigma Holdco BV				
5,750 % éch. 15/05/2026		300	217	0,12
Summer BidCo BV (9,000 % en numéraire ou 9,750 % de rémunération en nature)				
9,000 % éch. 15/11/2025 (a)		346	252	0,14
Telefonica Europe BV				
7,125 % éch. 23/08/2028 (d)		400	410	0,23
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV				
1,875 % éch. 31/03/2027		3 400	2 746	1,58
4,500 % éch. 01/03/2025		600	577	0,33
TMNL Holding BV				
3,750 % éch. 15/01/2029		550	483	0,28
United Group BV				
3,625 % éch. 15/02/2028		1 000	727	0,42
ZF Europe Finance BV				
2,000 % éch. 23/02/2026		500	432	0,25
			10 580	6,07
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Starfruit Finco BV				
5,052 % éch. 01/10/2025		944	903	0,52
Total Pays-Bas			11 483	6,59
PANAMA				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Carnival Corp.				
10,125 % éch. 01/02/2026		1 300	1 296	0,74
ESPAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Santander S.A.				
4,375 % éch. 14/01/2026 (d)(f)		600	511	0,29
CaixaBank S.A.				
5,875 % éch. 09/10/2027 (d)(f)		800	735	0,42
Cellnex Finance Co. S.A.				
1,500 % éch. 08/06/2028		2 000	1 669	0,96
2,000 % éch. 15/09/2032		1 300	969	0,56
2,000 % éch. 15/02/2033		200	148	0,08
Cellnex Telecom S.A.				
1,750 % éch. 23/10/2030		200	156	0,09
Total Espagne			4 188	2,40
SUÈDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Dometic Group AB				
2,000 % éch. 29/09/2028		1 000	794	0,46
Intrum AB				
3,125 % éch. 15/07/2024		313	302	0,17
4,875 % éch. 15/08/2025		1 100	1 005	0,58
9,250 % éch. 15/03/2028		1 800	1 784	1,02
Verisure Holding AB				
3,250 % éch. 15/02/2027		1 700	1 480	0,85
3,875 % éch. 15/07/2026		300	273	0,16
Verisure Midholding AB				
5,250 % éch. 15/02/2029		700	562	0,32
Volvo Car AB				
4,250 % éch. 31/05/2028		900	829	0,48
Total Suède			7 029	4,04
SUISSE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Credit Suisse Group AG				
6,442 % éch. 11/08/2028	$	400	342	0,20
9,016 % éch. 15/11/2033		600	577	0,33
9,750 % éch. 23/06/2027 (d)(f)	$	800	€ 655	0,37
Total Suisse			1 574	0,90
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Barclays PLC				
8,875 % éch. 15/09/2027 (d)(f)	£	300	334	0,19
BCP Modular Services Finance PLC				
4,750 % éch. 30/11/2028	€	600	505	0,29
6,750 % éch. 30/11/2029		500	372	0,21
Bellis Acquisition Co. PLC				
3,250 % éch. 16/02/2026	£	1 400	1 290	0,74
Burford Capital PLC				
5,000 % éch. 01/12/2026		700	696	0,40
EnQuest PLC				
11,625 % éch. 01/11/2027	$	400	353	0,20
Gatwick Airport Finance PLC				
4,375 % éch. 07/04/2026	£	1 500	1 530	0,88
Harbour Energy PLC				
5,500 % éch. 15/10/2026	$	800	673	0,39
Heathrow Finance PLC				
3,875 % éch. 01/03/2027	£	400	382	0,22
4,125 % éch. 01/09/2029		1 114	945	0,54
INEOS Quattro Finance PLC				
3,375 % éch. 15/01/2026	$	1 900	1 638	0,94
Jaguar Land Rover Automotive PLC				
4,500 % éch. 15/01/2026	€	800	691	0,40
4,500 % éch. 15/07/2028		400	305	0,17
Market Bidco Finco PLC				
4,750 % éch. 04/11/2027		1 600	1 291	0,74
Marks & Spencer PLC				
3,750 % éch. 19/05/2026	£	700	690	0,40
Rolls-Royce PLC				
0,875 % éch. 09/05/2024	€	600	566	0,32
4,625 % éch. 16/02/2026		2 100	2 042	1,18
Travis Perkins PLC				
3,750 % éch. 17/02/2026	£	500	501	0,29
Victoria PLC				
3,625 % éch. 24/08/2026	€	700	577	0,33
3,750 % éch. 15/03/2028		200	157	0,09
Virgin Media Secured Finance PLC				
4,250 % éch. 15/01/2030	£	1 600	1 407	0,81
Virgin Money UK PLC				
9,250 % éch. 08/06/2024 (d)(f)		800	903	0,52
Vmed O2 UK Financing PLC				
3,250 % éch. 31/01/2031	€	800	639	0,37
4,000 % éch. 31/01/2029	£	700	618	0,35
4,250 % éch. 31/01/2031	$	200	152	0,09
Zenith Finco PLC				
6,500 % éch. 30/06/2027	£	800	707	0,41
			19 964	11,47
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Lorca Holdco Ltd.				
6,319 % éch. 17/09/2027	€	2 300	2 208	1,27
Total Royaume-Uni			22 172	12,74
ÉTATS-UNIS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
American Airlines Pass-Through Trust				
3,375 % éch. 01/11/2028	$	469	368	0,21
3,700 % éch. 01/04/2028		457	371	0,21
Avantor Funding, Inc.				
3,875 % éch. 15/07/2028	€	1 100	1 019	0,58
Coty, Inc.				
3,875 % éch. 15/04/2026		2 100	1 961	1,13
Ford Motor Credit Co. LLC				
3,625 % éch. 17/06/2031	$	1 400	1 032	0,59
Gap, Inc.				
3,875 % éch. 01/10/2031		1 000	655	0,38
Graphic Packaging International LLC				
2,625 % éch. 01/02/2029	€	300	€ 263	0,15
IQVIA, Inc.				
2,250 % éch. 15/03/2029		1 000	846	0,49
Olympus Water U.S. Holding Corp.				
3,875 % éch. 01/10/2028		1 000	815	0,47
5,375 % éch. 01/10/2029		400	292	0,17
Organon & Co.				
2,875 % éch. 30/04/2028		1 100	967	0,55
Rio Oil Finance Trust				
8,200 % éch. 06/04/2028	$	1 447	1 376	0,79
Standard Industries, Inc.				
2,250 % éch. 21/11/2026	€	1 200	1 031	0,59
WMG Acquisition Corp.				
2,250 % éch. 15/08/2031		1 500	1 179	0,68
			12 175	6,99
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
INEOS Finance PLC				
3,898 % éch. 01/04/2024		2 549	2 545	1,46
Total États-Unis			14 720	8,45
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BONS DU TRÉSOR DU MÉCANISME EUROPÉEN DE STABILISATION				
1,541 % éch. 09/02/2023 (b)(c)		500	499	0,29
BONS DU TRÉSOR DE L'UNION EUROPÉENNE				
1,217 % éch. 06/01/2023 (b)(c)		900	900	0,52
1,350 % éch. 03/02/2023 (b)(c)		1 900	1 898	1,09
1,756 % éch. 03/03/2023 (b)(c)		6 290	6 272	3,60
1,866 % éch. 07/04/2023 (b)(c)		300	298	0,17
1,876 % éch. 07/04/2023 (b)(c)		1 100	1 094	0,63
			10 462	6,01
BONS DU TRÉSOR FRANÇAIS				
0,801 % éch. 04/01/2023 (b)(c)		40	40	0,02
0,904 % éch. 08/02/2023 (b)(c)		400	399	0,23
0,918 % éch. 08/02/2023 (b)(c)		300	300	0,17
0,994 % éch. 22/02/2023 (b)(c)		300	299	0,17
1,282 % éch. 08/02/2023 (b)(c)		1 900	1 897	1,09
1,467 % éch. 15/02/2023 (b)(c)		100	100	0,06
1,482 % éch. 01/03/2023 (b)(c)		10	10	0,01
1,483 % éch. 01/03/2023 (b)(c)		850	848	0,49
1,493 % éch. 01/03/2023 (b)(c)		1 340	1 337	0,77
1,600 % éch. 22/03/2023 (b)(c)		150	149	0,08
1,612 % éch. 22/03/2023 (b)(c)		150	149	0,08
1,625 % éch. 22/03/2023 (b)(c)		150	149	0,08
1,666 % éch. 22/03/2023 (b)(c)		400	399	0,23
1,719 % éch. 15/03/2023 (b)(c)		500	498	0,29
1,724 % éch. 15/03/2023 (b)(c)		350	349	0,20
1,734 % éch. 15/03/2023 (b)(c)		700	698	0,40
1,735 % éch. 15/03/2023 (b)(c)		300	299	0,17
1,784 % éch. 15/03/2023 (b)(c)		50	50	0,03
			7 970	4,57
BONS DU TRÉSOR ALLEMAND				
0,958 % échéance 18/01/2023 (b)(c)		400	400	0,23
Total des Instruments à court terme			19 331	11,10
Total des Valeurs mobilières			**€ 157 222**	**90,28**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (e)	91 400	8 700	5,00
Total des Fonds d'investissement		**€ 8 700**	**5,00**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BPS	(1,000) %	30/12/2022	02/01/2023	€ 3 700	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,625 % échéance 07/01/2028	€ (3 743)	€ 3 700	€ 3 700	2,12
Total des Contrats de mise en pension						**€ (3 743)**	**€ 3 700**	**€ 3 700**	**2,12**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Long	03/2023	59	€ (252)	(0,14)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	5	14	0,01
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars	Long	03/2023	380	(531)	(0,31)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Court	03/2023	24	3	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Court	03/2023	4	1	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Court	03/2023	9	17	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	16	57	0,03
				€ (691)	(0,40)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**€ (691)**	**(0,40)**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000 %	20/12/2027	€ 100	€ (3)	(0,01)
United Group BV	5,000	20/12/2027	700	9	0,01
				€ 6	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice iTraxx Crossover 38 à 5 ans	5,000 %	20/12/2027	€ 17 800	€ 304	0,17

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250 %	15/03/2028	£ 1 600	€ (47)	(0,03)
À payer[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,500	15/03/2025	5 400	(16)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027	$ 2 100	81	0,05
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,000	16/12/2025	3 800	428	0,25
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,000	16/12/2030	3 000	540	0,31
					€ 986	0,57
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**€ 1 296**	**0,74**

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

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

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

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

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

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018 %	20/10/2023	1 300	€ (8)	€ (1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	1 300	(8)	(16)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	1 300	(9)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	1 300	(9)	(14)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	1 300	(8)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	1 300	(8)	(14)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	1 300	(8)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	1 300	(8)	(14)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	1 300	(8)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	1 300	(8)	(16)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	1 300	(9)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	1 300	(8)	(17)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	400	(3)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,088	03/11/2023	400	(3)	(4)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,721	08/04/2024	100	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,721	08/04/2024	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547	07/03/2023	1 500	(31)	(3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	1 500	(31)	(89)	(0,05)
							€ (169)	€ (198)	(0,12)

[1] Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Deutsche Bank AG	1,000 %	20/06/2027	€ 600	€ (81)	€ 43	€ (38)	(0,02)

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

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

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€	895	$	945	€ 0	€ (11)	€ (11)	(0,01)
BPS	01/2023	$	1 887	€	1 783	16	0	16	0,01
BRC	01/2023	£	2 524		2 924	80	0	80	0,05
CBK	01/2023	€	213	$	226	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	£	557	€	647	20	0	20	0,01
	01/2023	$	165		155	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	CHF	68		69	0	0	0	0,00
	01/2023	$	14 752		14 046	230	0	230	0,13
MYI	01/2023	€	448	$	469	0	(8)	(8)	0,00
	01/2023	£	31	€	35	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	CHF	1 147		1 167	5	0	5	0,00
	01/2023	£	6 628		7 671	202	0	202	0,12
						€ 553	€ (20)	€ 533	0,31

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**€ 297**	**0,17**
Total des Investissements	**€ 170 524**	**97,91**
Autres actifs et passifs à court terme	**€ 3 638**	**2,09**
Actif net	**€ 174 162**	**100,00**

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à rémunération en nature.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

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

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titre convertible conditionnel.

Un montant en numéraire de 2 986 € (31 décembre 2021 : 897 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	€ 0	€ 157 222	€ 0	€ 157 222
Fonds d'investissement	8 700	0	0	8 700
Contrats de mise en pension	0	3 700	0	3 700
Instruments financiers dérivés[3]	(769)	1 671	0	902
Totaux	**€ 7 931**	**€ 162 593**	**€ 0**	**€ 170 524**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	€ 0	€ 154 011	€ 0	€ 154 011
Fonds d'investissement	0	9 575	0	9 575
Contrats de mise en pension	0	4 900	0	4 900
Instruments financiers dérivés[3]	(140)	203	0	63
Totaux	**€ (140)**	**€ 168 689**	**€ 0**	**€ 168 549**

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

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

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	€ (11)	€ 0	€ (11)	€ S/O	€ S/O	€ S/O
BPS	(22)	0	(22)	S/O	S/O	S/O
BRC	80	0	80	S/O	S/O	S/O
CBK	19	0	19	S/O	S/O	S/O
GLM	(198)	0	(198)	5	0	5
MBC	230	0	230	S/O	S/O	S/O
MYI	(8)	0	(8)	(4)	0	(4)
SCX	207	0	207	44	0	44

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	80,86	74,05
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	8,16	11,84
Autres valeurs mobilières	1,26	4,44
Fonds d'investissement	5,00	5,62
Contrats de mise en pension	2,12	2,87
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,40)	(0,08)
Instruments financiers dérivés compensés	0,74	0,09
Instruments financiers dérivés hors cote	0,17	0,03

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Autriche	S/O	0,47
Îles Caïmans	0,02	0,04
Chine	0,01	0,85
République tchèque	1,23	S/O
Danemark	1,34	0,60
France	12,16	11,44
Allemagne	6,94	7,90
Irlande	1,03	1,27
Île de Man	1,03	1,04
Italie	8,16	6,64
Japon	0,97	1,24
Jersey, îles Anglo-Normandes	1,28	2,07
Luxembourg	8,62	11,64
Mexique	S/O	1,04
Multinationales	0,53	0,35
Pays-Bas	6,59	8,64
Panama	0,74	0,87
Roumanie	S/O	0,98
Espagne	2,40	0,42
Suède	4,04	4,00
Suisse	0,90	S/O
Royaume-Uni	12,74	9,73
États-Unis	8,45	18,63
Instruments à court terme	11,10	0,47
Fonds d'investissement	5,00	5,62
Contrats de mise en pension	2,12	2,87
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,40)	(0,08)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	S/O
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,17	(0,01)
Swaps de taux d'intérêt	0,57	0,10
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Swaptions de taux d'intérêt	(0,12)	S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,02)	S/O
Contrats de change à terme	0,31	0,03
Autres actifs et passifs à court terme	2,09	1,14
Actif net	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				
ABN AMRO Bank NV				
4,375 % éch. 22/09/2025 (d)(f)	€	1 000	€ 925	0,44
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.				
3,205 % éch. 15/11/2024		1 100	1 094	0,52
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
5,875 % éch. 24/09/2023 (d)(f)		600	578	0,27
Banco Santander S.A.				
3,625 % éch. 21/03/2029 (d)(f)		600	418	0,20
Bank of Ireland Group PLC				
7,500 % éch. 19/05/2025 (d)(f)		300	292	0,14
Barclays PLC				
1,500 % éch. 03/09/2023		500	495	0,23
2,885 % éch. 31/01/2027		900	853	0,40
7,250 % éch. 15/03/2023 (d)(f)	£	300	335	0,16
7,750 % éch. 15/09/2023 (d)(f)	$	200	183	0,09
Bevco Lux SARL				
1,000 % éch. 16/01/2030	€	1 300	980	0,46
Charles Schwab Corp.				
4,646 % éch. 13/05/2026	$	1 200	1 092	0,52
Cooperatieve Rabobank UA				
3,250 % éch. 29/12/2026 (d)(f)	€	400	342	0,16
4,875 % éch. 29/06/2029 (d)(f)		200	172	0,08
CPI Property Group S.A.				
1,625 % éch. 23/04/2027		400	286	0,14
Credit Suisse AG				
3,184 % éch. 31/05/2024		900	872	0,41
Credit Suisse Group AG				
1,250 % éch. 17/07/2025		900	809	0,38
4,207 % éch. 12/06/2024	$	1 100	1 005	0,48
7,250 % éch. 12/09/2025 (d)(f)		700	472	0,22
7,500 % éch. 17/07/2023 (d)(f)		600	451	0,21
Credit Suisse Schweiz AG				
3,390 % éch. 05/12/2025	€	1 200	1 183	0,56
CTP NV				
0,500 % éch. 21/06/2025		800	672	0,32
0,625 % éch. 27/09/2026		500	385	0,18
Deutsche Bank AG				
2,222 % éch. 18/09/2024	$	200	181	0,09
2,625 % éch. 16/12/2024	£	1 200	1 258	0,60
4,000 % éch. 29/11/2027	€	1 100	1 088	0,52
Dexia Credit Local S.A.				
0,000 % éch. 21/01/2028 (a)		400	340	0,16
DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH				
2,500 % éch. 25/01/2027		1 400	1 050	0,50
Ford Motor Credit Co. LLC				
1,744 % éch. 19/07/2024		400	383	0,18
2,748 % éch. 14/06/2024	£	900	961	0,45
General Motors Financial Co., Inc.				
1,000 % éch. 24/02/2025	€	200	187	0,09
Goldman Sachs Group, Inc.				
2,605 % éch. 30/04/2024		600	600	0,28
2,732 % éch. 07/02/2025		1 100	1 098	0,52
5,702 % éch. 15/03/2024	$	300	281	0,13
ING Groep NV				
4,875 % éch. 16/05/2029 (d)(f)		200	145	0,07
5,750 % éch. 16/11/2026 (d)(f)		800	666	0,32
Jyske Realkredit A/S				
0,500 % éch. 01/10/2040	DKK	0	0	0,00
1,000 % éch. 01/10/2050		31 558	2 952	1,40
1,000 % éch. 01/10/2053		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		3 979	403	0,19
LeasePlan Corp. NV				
0,125 % éch. 13/09/2023	€	600	585	0,28
3,500 % éch. 09/04/2025		1 200	1 175	0,56
Liberty Living Finance PLC				
2,625 % éch. 28/11/2024	£	1 200	1 260	0,60
Logicor Financing SARL				
0,750 % éch. 15/07/2024	€	700	643	0,30
NatWest Group PLC				
4,269 % éch. 22/03/2025	$	300	275	0,13
Nexi SpA				
1,625 % éch. 30/04/2026	€	398	364	0,17
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
0,500 % éch. 01/10/2040	DKK	0	€ 0	0,00
1,000 % éch. 01/10/2050		59 864	5 780	2,74
1,000 % éch. 01/10/2053		6 756	621	0,29
1,500 % éch. 01/10/2050		8 726	883	0,42
1,500 % éch. 01/10/2053		7 600	745	0,35
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % éch. 27/01/2025	€	800	726	0,34
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,650 % éch. 19/11/2029		400	336	0,16
Nova Ljubljanska Banka dd				
10,750 % éch. 28/11/2032		900	913	0,43
Nykredit Realkredit A/S				
0,500 % éch. 01/10/2040	DKK	0	0	0,00
1,000 % éch. 01/10/2050		146	14	0,01
1,000 % éch. 01/10/2053		3 541	325	0,15
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		11 204	1 076	0,51
2,000 % éch. 01/10/2053		7 255	776	0,37
3,000 % éch. 01/10/2053		2 179	260	0,12
3,500 % éch. 01/10/2053		19 616	2 425	1,15
5,000 % éch. 01/10/2053		8 800	1 155	0,55
Permanent TSB Group Holdings PLC				
2,125 % éch. 26/09/2024	€	1 000	959	0,45
5,250 % éch. 30/06/2025		600	579	0,27
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	18 977	1 882	0,89
1,000 % éch. 01/10/2053		50	5	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		274	27	0,01
2,000 % éch. 01/10/2053		54 841	5 629	2,68
3,000 % éch. 01/10/2053		13 793	1 650	0,78
Royal Bank of Canada				
4,784 % éch. 12/12/2025	$	1 100	1 027	0,49
Sagax AB				
2,000 % éch. 17/01/2024	€	1 100	1 055	0,50
Sirius Real Estate Ltd.				
1,125 % éch. 22/06/2026		400	313	0,15
Société Générale S.A.				
7,875 % éch. 18/12/2023 (d)(f)	$	300	279	0,13
Sparebanken Soer Boligkreditt A/S				
3,125 % éch. 14/11/2025	€	1 100	1 092	0,52
Toronto-Dominion Bank				
1,707 % éch. 28/07/2025		700	671	0,32
TP ICAP Finance PLC				
5,250 % éch. 26/01/2024	£	358	394	0,19
UniCredit SpA				
7,830 % éch. 04/12/2023	$	2 050	1 941	0,92
Volkswagen Bank GmbH				
1,875 % éch. 31/01/2024	€	3 900	3 823	1,81
Volkswagen Financial Services NV				
0,875 % éch. 20/02/2025	£	400	408	0,19
			67 558	32,00
INDUSTRIE				
Abertis Infraestructuras S.A.				
3,375 % éch. 27/11/2026		200	204	0,10
Crown European Holdings S.A.				
2,625 % éch. 30/09/2024	€	1 400	1 373	0,65
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide				
1,625 % éch. 09/07/2024		2 400	2 324	1,10
GE Capital UK Funding Unlimited Co.				
4,125 % éch. 13/09/2023	£	200	224	0,10
GN Store Nord A/S				
0,875 % éch. 25/11/2024	€	1 300	1 171	0,55
Heathrow Funding Ltd.				
5,225 % éch. 15/02/2023	£	1 100	1 240	0,59
Highland Holdings SARL				
0,000 % éch. 12/11/2023 (a)	€	900	874	0,41
Informa PLC				
1,500 % éch. 05/07/2023		100	99	0,05
John Lewis PLC				
6,125 % éch. 21/01/2025	£	500	542	0,26
Market Bidco Finco PLC				
4,750 % éch. 04/11/2027	€	600	484	0,23
Molnlycke Holding AB				
1,750 % éch. 28/02/2024		300	293	0,14
Prosus NV				
3,257 % éch. 19/01/2027	$	1 100	€ 923	0,44
Silfin NV				
2,875 % éch. 11/04/2027	€	700	595	0,28
Travis Perkins PLC				
4,500 % éch. 07/09/2023	£	1 100	1 225	0,58
Ubisoft Entertainment S.A.				
1,289 % éch. 30/01/2023	€	1 000	998	0,47
			12 569	5,95
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
Électricité de France S.A.				
2,625 % éch. 01/12/2027 (d)		800	626	0,30
2,875 % éch. 15/12/2026 (d)		1 000	823	0,39
EnBW International Finance BV				
3,625 % éch. 22/11/2026		200	200	0,09
Sprint LLC				
7,125 % éch. 15/06/2024	$	300	287	0,14
7,875 % éch. 15/09/2023		1 000	952	0,45
			2 888	1,37
Total des Obligations et billets privés			83 015	39,32
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				
3,000 % éch. 01/02/2053		8 750	7 204	3,41
4,000 % éch. 01/02/2053		3 050	2 681	1,27
4,500 % éch. 01/02/2053		1 200	1 082	0,51
			10 967	5,19
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (c)				
0,125 % éch. 15/07/2031		1 556	1 290	0,61
0,125 % éch. 15/02/2051		801	484	0,23
0,500 % éch. 15/01/2028		846	746	0,35
1,625 % éch. 15/10/2027		2 917	2 731	1,30
			5 251	2,49
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Alba PLC				
3,692 % éch. 15/12/2038	£	648	679	0,32
Avon Finance PLC				
4,331 % éch. 20/09/2048		918	1 015	0,48
Barley Hill PLC				
4,352 % éch. 27/08/2058		307	343	0,16
Canterbury Finance PLC				
4,335 % éch. 16/05/2057		57	64	0,03
Charter Mortgage Funding PLC				
3,935 % éch. 16/01/2057		189	211	0,10
Cheshire PLC				
4,171 % éch. 20/08/2045		266	295	0,14
Dilosk RMBS DAC				
2,552 % éch. 20/02/2060	€	424	421	0,20
2,747 % éch. 20/12/2060		821	811	0,38
Domi BV				
2,896 % éch. 15/06/2051		191	189	0,09
Dutch Property Finance BV				
2,228 % éch. 28/07/2058		703	694	0,33
2,278 % éch. 28/04/2059		795	783	0,37
2,328 % éch. 28/10/2059		751	740	0,35
2,828 % éch. 28/04/2050		674	660	0,31
Eurosail PLC				
2,165 % éch. 13/03/2045		188	186	0,09
Fingal Securities RMBS DAC				
2,578 % éch. 28/07/2055		147	146	0,07
Finsbury Square PLC				
4,709 % éch. 16/06/2070	£	219	246	0,12
Glenbeigh Issuer DAC				
2,875 % éch. 24/06/2050	€	336	326	0,15
Harbour Energy PLC				
3,844 % éch. 28/01/2054	£	632	701	0,33
Harmony French Home Loans				
2,558 % éch. 27/05/2062	€	358	359	0,17
Hops Hill PLC				
4,732 % éch. 27/11/2054	£	297	327	0,15

Tableau des investissements Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Jubilee Place BV				
2,378 % éch. 17/10/2057	€	197	€ 196	0,09
Landmark Mortgage Securities PLC				
3,668 % éch. 17/04/2044	£	625	661	0,31
Lanebrook Mortgage Transaction PLC				
3,576 % éch. 20/07/2058		558	609	0,29
4,487 % éch. 12/06/2057		453	508	0,24
Miravet SARL				
2,758 % éch. 26/05/2065	€	521	503	0,24
Polaris PLC				
4,222 % éch. 23/12/2058	£	1 117	1 229	0,58
4,232 % éch. 23/10/2059		478	527	0,25
4,682 % éch. 27/05/2057		350	393	0,19
Precise Mortgage Funding PLC				
4,587 % éch. 12/12/2055		387	433	0,21
Primrose Residential DAC				
2,644 % éch. 24/03/2061	€	2 693	2 630	1,25
2,894 % éch. 24/10/2061		834	813	0,39
Residential Mortgage Securities PLC				
4,681 % éch. 20/06/2070	£	460	517	0,24
Resloc UK PLC				
3,682 % éch. 15/12/2043		280	301	0,14
Ripon Mortgages PLC				
4,011 % éch. 28/08/2056		1 033	1 143	0,54
Shamrock Residential DAC				
2,744 % éch. 24/12/2059	€	706	695	0,33
Stanlington PLC				
4,337 % éch. 12/06/2045	£	510	563	0,27
Stratton Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2060		1 823	2 038	0,97
4,087 % éch. 12/12/2043		532	590	0,28
4,287 % éch. 12/03/2052		545	612	0,29
4,292 % éch. 25/09/2051		974	1 083	0,51
Towd Point Mortgage Funding PLC				
3,596 % éch. 20/10/2051		500	550	0,26
3,826 % éch. 20/07/2045		336	375	0,18
4,171 % éch. 20/05/2045		707	785	0,37
4,471 % éch. 20/02/2054		626	703	0,33
Tower Bridge Funding PLC				
4,051 % éch. 20/11/2063		966	1 068	0,51
Trinity Square PLC				
3,729 % éch. 15/07/2059		864	963	0,46
Tudor Rose Mortgages				
4,031 % éch. 20/06/2048		321	356	0,17
Twin Bridges PLC				
4,637 % éch. 12/12/2054		489	549	0,26
			30 589	14,49
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Adagio CLO DAC				
2,098 % éch. 15/10/2031	€	300	292	0,14
Ares European CLO DAC				
2,158 % éch. 15/10/2031		500	485	0,23
Armada Euro CLO DAC				
2,098 % éch. 15/07/2031		700	680	0,32
Aurium CLO DAC				
2,048 % éch. 16/04/2030		199	195	0,09
2,108 % éch. 16/01/2031		1 000	978	0,46
3,152 % éch. 23/03/2032		754	738	0,35
Auto ABS French Leases FCT				
2,595 % éch. 29/06/2033		982	981	0,46
Bain Capital Euro CLO DAC				
2,196 % éch. 20/01/2032		600	585	0,28
Bavarian Sky S.A.				
2,448 % éch. 20/05/2027		92	92	0,04
BBVA Consumer Auto				
0,270 % éch. 20/07/2031		185	181	0,09
Black Diamond CLO DAC				
2,316 % éch. 20/01/2032		579	566	0,27
2,778 % éch. 15/05/2032		500	485	0,23
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				
1,050 % éch. 15/01/2031	€	100	€ 90	0,04
2,028 % éch. 15/07/2030		626	612	0,29
2,098 % éch. 15/01/2031		600	583	0,28
2,288 % éch. 15/01/2033		800	771	0,37
BNPP AM Euro CLO DAC				
2,028 % éch. 15/10/2031		296	290	0,14
2,322 % éch. 22/07/2032		800	775	0,37
Bridgepoint CLO DAC				
2,588 % éch. 15/01/2034		300	294	0,14
Bumper UK Finance PLC				
3,900 % éch. 20/12/2030	£	314	354	0,17
Carlyle Euro CLO DAC				
2,078 % éch. 15/01/2031	€	400	390	0,18
2,428 % éch. 15/08/2030		498	486	0,23
2,688 % éch. 15/08/2032		800	777	0,37
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				
2,273 % éch. 25/01/2032		800	783	0,37
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
2,548 % éch. 15/11/2031		1 100	1 066	0,50
Citizen Irish Auto Receivables Trust DAC				
2,506 % éch. 15/12/2029		362	361	0,17
Compartment VCL				
2,497 % éch. 21/01/2028		469	470	0,22
Contego CLO DAC				
2,142 % éch. 23/01/2030		499	486	0,23
CVC Cordatus Loan Fund DAC				
2,028 % éch. 15/10/2031		1 800	1 748	0,83
2,676 % éch. 15/09/2031		300	292	0,14
Dryden Euro CLO DAC				
2,038 % éch. 15/04/2033		400	388	0,18
FCT Pulse France				
2,198 % éch. 25/01/2035		400	400	0,19
Harvest CLO DAC				
1,040 % éch. 15/07/2031		400	361	0,17
2,018 % éch. 15/10/2031		600	583	0,28
2,136 % éch. 20/10/2031		1 800	1 748	0,83
2,138 % éch. 15/07/2031		700	676	0,32
2,228 % éch. 15/01/2032		1 200	1 163	0,55
2,775 % éch. 26/06/2030		676	661	0,31
Man GLG Euro CLO DAC				
2,058 % éch. 15/10/2030		375	367	0,17
2,188 % éch. 15/10/2032		600	580	0,27
Palmer Square European Loan Funding DAC				
2,098 % éch. 15/10/2031		1 076	1 043	0,49
2,108 % éch. 15/07/2031		911	887	0,42
2,428 % éch. 15/10/2031		1 262	1 233	0,58
PBD Germany Auto Lease Master S.A., Compartment				
2,594 % éch. 26/11/2030		480	480	0,23
Purple Master Credit Cards				
2,594 % éch. 25/05/2034		600	600	0,28
Sculptor European CLO DAC				
2,153 % éch. 14/01/2032		700	681	0,32
Segovia European CLO DAC				
2,173 % éch. 18/01/2031		196	192	0,09
2,336 % éch. 20/07/2032		800	775	0,37
Silver Arrow Merfina SRL				
2,448 % éch. 20/07/2033		703	703	0,33
Silver Arrow S.A.				
2,386 % éch. 15/02/2027		57	57	0,03
Tikehau CLO DAC				
2,596 % éch. 04/08/2034		600	582	0,28
Toro European CLO DAC				
2,239 % éch. 12/01/2032		1 200	1 156	0,55
2,572 % éch. 15/02/2034		1 000	964	0,46
Turbo Finance PLC				
4,230 % éch. 20/08/2028	£	182	205	0,10
Voya Euro CLO DAC				
2,128 % éch. 15/10/2030	€	300	294	0,14
			33 665	15,94
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Agence Française de Développement				
0,125 % éch. 29/09/2031	€	400	€ 301	0,14
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale				
0,125 % éch. 15/09/2031		2 300	1 753	0,83
Obligation internationale du gouvernement français				
0,100 % éch. 25/07/2031 (c)		115	110	0,05
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
1,300 % éch. 15/05/2028 (c)		842	814	0,39
1,400 % éch. 26/05/2025 (c)		11 042	10 902	5,16
Obligation internationale du gouvernement slovène				
1,175 % éch. 13/02/2062		1 300	641	0,30
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen				
0,000 % éch. 16/09/2025 (a)		500	456	0,22
			14 977	7,09
ACTIONS				
TITRES PRIVILÉGIÉS				
Nationwide Building Society				
10,250 %		4 500	635	0,30
INSTRUMENTS À COURT TERME		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
BILLETS DE TRÉSORERIE				
Acciona Energia Financiacion Filiales S.A.				
2,078 % éch. 16/01/2023	€	800	799	0,38
Nomura Bank International PLC				
2,078 % éch. 28/02/2023		700	697	0,33
SGS Nederland Holding BV				
2,099 % éch. 30/01/2023		700	699	0,33
2,109 % éch. 12/01/2023		600	600	0,28
2,210 % éch. 19/01/2023		500	499	0,24
Universal Music Group NV				
2,099 % éch. 13/02/2023		400	399	0,19
			3 693	1,75
BONS DU TRÉSOR DU MÉCANISME EUROPÉEN DE STABILISATION				
1,763 % éch. 23/02/2023 (a)(b)	€	210	210	0,10
BONS DU TRÉSOR FRANÇAIS				
0,254 % éch. 04/01/2023 (a)(b)		400	400	0,19
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS				
(0,160) % éch. 30/01/2023 (a)(b)	¥	493 900	3 508	1,66
(0,149) % éch. 30/01/2023 (a)(b)		226 100	1 606	0,76
(0,111) % éch. 20/02/2023 (a)(b)		680 000	4 830	2,29
			9 944	4,71
Total des Instruments à court terme			14 247	6,75
Total des Valeurs mobilières			**€ 193 346**	**91,57**
ACTIONS				
FONDS D'INVESTISSEMENT				
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE				
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (e)		197 500	18 800	8,90
Total des Fonds d'investissement			**€ 18 800**	**8,90**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BPS	(1,000) %	30/12/2022	02/01/2023	€ 4 400	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,625 % échéance 07/01/2028	€ (4 454)	€ 4 400	€ 4 400	2,08
Total des Contrats de mise en pension						**€ (4 454)**	**€ 4 400**	**€ 4 400**	**2,08**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	5	€ 4	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Long	03/2023	69	(229)	(0,11)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	Court	03/2023	67	539	0,26
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	54	206	0,10
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	Court	03/2023	56	1 145	0,53
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars	Court	03/2023	1	9	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars	Long	03/2023	387	(541)	(0,26)
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Long	03/2023	1	(9)	0,00
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	5	(24)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Court	03/2023	11	0	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	47	(72)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	154	(87)	(0,04)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Court	03/2023	20	(1)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	162	156	0,07
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Long	03/2023	50	(368)	(0,17)
				€ 728	0,34
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**€ 728**	**0,34**

(1) Option de style contrat à terme standardisé.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice iTraxx Crossover 37 à 5 ans	(5,000) %	20/06/2027	€ 3 800	€ (124)	(0,06)
Indice iTraxx Europe Main 38 à 5 ans	(1,000)	20/12/2027	23 000	(316)	(0,15)
				€ (440)	(0,21)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[2]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000 %	20/12/2027	$ 1 900	€ 15	0,01

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000 %	15/03/2033	£ 3 000	€ (302)	(0,14)
À recevoir[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053	1 100	(192)	(0,09)
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	3,500	12/12/2027	2 500	(24)	(0,01)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	16/06/2029	¥ 1 048 000	130	0,06
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,435	20/06/2029	312 000	33	0,01
À recevoir	ESTRON EUR composé-OIS à 3 mois	1,250	13/03/2023	€ 151 100	(47)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,880	25/01/2052	$ 1 800	(491)	(0,23)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,000	17/03/2036	€ 2 400	702	0,33
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,190	04/11/2052	1 100	452	0,21
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	0,193	23/06/2035	2 900	(558)	(0,26)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,195	04/11/2052	1 150	543	0,26
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	800	(32)	(0,02)

Tableau des investissements Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund (suite)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	0,819 %	19/12/2034	€ 6 800	€ (596)	(0,28)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	0,854	19/12/2039	3 300	(475)	(0,23)
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2025	78 900	1 728	0,82
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028	7 900	324	0,15
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053	200	(17)	(0,01)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	10 500	(484)	(0,23)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	12/12/2032	2 500	(83)	(0,04)
À payer	CPTFEMU	1,380	15/03/2031	700	(122)	(0,06)
À payer	CPTFEMU	3,520	15/09/2024	300	(4)	0,00
À payer	CPTFEMU	3,720	15/09/2024	700	(7)	0,00
À payer	CPTFEMU	3,850	15/09/2024	500	(5)	0,00
À payer	CPURNSA	4,950	07/03/2023	$ 1 600	(22)	(0,01)
À payer	CPURNSA	5,033	08/03/2023	4 800	(61)	(0,03)
					€ 390	0,18
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**€ (35)**	**(0,02)**

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

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

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

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

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

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

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,000 %	15/03/2023	1 100	€ 103	€ 558	0,26
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,410	02/02/2023	20 100	89	0	0,00
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,720	23/02/2023	4 300	21	0	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,200	26/04/2023	3 100	31	2	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,710	25/01/2023	4 600	25	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,000	15/03/2023	900	82	457	0,22
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,428	31/01/2023	20 100	92	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,200	31/05/2023	8 800	100	10	0,00
							€ 543	€ 1 027	0,48

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,490 %	20/01/2023	8 400	€ (313)	€ (1)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,590	22/01/2024	4 200	(159)	(9)	0,00
BPS	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,175	15/03/2023	3 300	(101)	(950)	(0,45)
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,558	02/02/2023	4 400	(89)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,065	19/06/2025	6 600	(249)	(35)	(0,02)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À recevoir	4,308	23/01/2023	1 500	(59)	(82)	(0,04)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À payer	4,308	23/01/2023	1 500	(59)	(5)	0,00
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,736	23/02/2023	900	(20)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À recevoir	4,290	17/01/2023	1 500	(64)	(78)	(0,04)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À payer	4,290	17/01/2023	1 500	(64)	(3)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,350	26/04/2023	1 700	(32)	(3)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547	07/03/2023	700	(15)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	700	(15)	(41)	(0,02)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	800	(9)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	800	(10)	(25)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,590	22/01/2024	4 200	(206)	(11)	0,00
GST	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	3,230	18/01/2023	1 300	(35)	(14)	(0,01)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,230	18/01/2023	1 300	(35)	(10)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,804	17/05/2023	2 700	(85)	(29)	(0,01)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,804	17/05/2023	2 700	(85)	(124)	(0,06)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À recevoir	4,670	10/01/2023	1 600	(65)	(135)	(0,06)

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À payer	4,670 %	10/01/2023	1 600	€ (65)	€ 0	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,785	25/01/2023	1 000	(24)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,175	15/03/2023	2 700	(81)	(778)	(0,37)
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,579	31/01/2023	4 400	(92)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,350	31/05/2023	4 800	(99)	(13)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,008	17/12/2029	5 500	(341)	(155)	(0,07)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,008	17/12/2029	10 900	(352)	(151)	(0,07)
							€ (2 823)	€ (2 655)	(1,25)

[1] Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$ 95	€ 91	€ 3	€ 0	€ 3	0,00
BOA	01/2023	€ 1 026	DKK 7 630	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 767	€ 724	6	0	6	0,00
	02/2023	£ 193	218	1	0	1	0,00
	02/2023	¥ 32 000	222	0	(6)	(6)	0,00
BPS	01/2023	€ 413	$ 437	0	(4)	(4)	0,00
	02/2023	209	£ 185	0	(1)	(1)	0,00
BRC	01/2023	809	$ 862	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$ 210	CNH 1 464	2	0	2	0,00
	01/2023	1 156	€ 1 112	29	0	29	0,01
CBK	01/2023	DKK 2 150	289	0	0	0	0,00
	01/2023	€ 235	DKK 1 745	0	0	0	0,00
	01/2023	284	$ 302	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 1 493	€ 1 420	21	0	21	0,01
	02/2023	€ 633	£ 559	0	(4)	(4)	0,00
	03/2023	$ 64	MXN 1 248	0	0	0	0,00
CLY	02/2023	100	£ 84	1	0	1	0,00
GLM	01/2023	218	CNH 1 520	1	0	1	0,00
JPM	01/2023	€ 679	DKK 5 050	0	0	0	0,00
	01/2023	ILS 116	$ 34	1	0	1	0,00
	01/2023	$ 148	€ 140	2	0	2	0,00
	02/2023	€ 291	£ 251	0	(8)	(8)	0,00
MBC	01/2023	DKK 65	€ 9	0	0	0	0,00
	01/2023	€ 648	$ 684	0	(7)	(7)	0,00
	01/2023	¥ 720 000	€ 4 928	0	(192)	(192)	(0,09)
	01/2023	$ 16 261	15 503	274	0	274	0,13
	02/2023	€ 23	SEK 247	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	¥ 680 000	€ 4 734	0	(110)	(110)	(0,05)
	05/2023	CNH 2 981	$ 444	9	0	9	0,00
MYI	01/2023	€ 218	DKK 1 625	0	0	0	0,00
	01/2023	1 874	$ 1 981	0	(19)	(19)	(0,01)
	01/2023	$ 459	€ 435	5	0	5	0,00
	02/2023	€ 228	£ 197	0	(7)	(7)	0,00
	02/2023	53	¥ 7 626	1	0	1	0,00
	02/2023	£ 59	€ 68	2	0	2	0,00
RBC	02/2023	$ 50	£ 42	0	0	0	0,00
RYL	02/2023	€ 214	¥ 30 300	2	0	2	0,00
	02/2023	£ 106	€ 122	3	0	3	0,00
	02/2023	$ 25	CHF 24	1	0	1	0,00
SCX	01/2023	DKK 212 651	€ 28 603	6	0	6	0,00
SSB	02/2023	£ 27 462	31 290	391	0	391	0,19
				€ 761	€ (362)	€ 399	0,19

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**€ (1 229)**	**(0,58)**
Total des Investissements	**€ 216 010**	**102,29**
Autres actifs et passifs à court terme	**€ (4 838)**	**(2,29)**
Actif net	**€ 211 172**	**100,00**

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

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

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(c) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

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

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titre convertible conditionnel.

Un titre d'une juste valeur globale de 0 € (31 décembre 2021 : 613 €) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 3 688 € (31 décembre 2021 : 4 806 €) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 1 165 € (31 décembre 2021 : 2 223 € a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	€ 0	€ 193 346	€ 0	€ 193 346
Fonds d'investissement	18 800	0	0	18 800
Contrats de mise en pension	0	4 400	0	4 400
Instruments financiers dérivés[3]	731	(1 267)	0	(536)
Totaux	**€ 19 531**	**€ 196 479**	**€ 0**	**€ 216 010**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	€ 0	€ 351 206	€ 0	€ 351 206
Fonds d'investissement	0	26 155	0	26 155
Contrats de mise en pension	0	11 681	0	11 681
Instruments financiers dérivés[3]	1 838	(4 909)	0	(3 071)
Totaux	**€ 1 838**	**€ 384 133**	**€ 0**	**€ 385 971**

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

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

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	€ 3	€ 0	€ 3	€ S/O	€ S/O	€ S/O
BOA	(9)	(440)	(449)	(388)	0	(388)
BPS	(397)	360	(37)	(112)	0	(112)
BRC	(93)	0	(93)	(202)	(26)	(228)
CBK	(65)	290	225	(303)	250	(53)
CLY	1	0	1	S/O	S/O	S/O
DUB	S/O	S/O	S/O	4	0	4
GLM	(80)	(169)	(249)	(193)	0	(193)
GSC	S/O	S/O	S/O	(3)	0	(3)
GST	(312)	253	(59)	S/O	S/O	S/O
HUS	S/O	S/O	S/O	(60)	0	(60)
JPM	(326)	262	(64)	(37)	0	(37)
MBC	(27)	0	(27)	S/O	S/O	S/O
MYC	(309)	(253)	(562)	(735)	53	(682)
MYI	(18)	0	(18)	(5)	0	(5)
RBC	S/O	S/O	S/O	(5)	0	(5)
RYL	6	0	6	(1 672)	1 680	8
SCX	6	0	6	(259)	240	(19)
SSB	391	(328)	63	S/O	S/O	S/O
UAG	S/O	S/O	S/O	(3)	0	(3)

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

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	78,37	86,65
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	13,20	2,15
Fonds d'investissement	8,90	6,61
Contrats de mise en pension	2,08	2,95
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,34	0,47
Instruments financiers dérivés compensés	(0,02)	(0,24)
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,58)	(1,00)
Contrats de prise en pension	S/O	(0,15)

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Obligations et billets privés	39,32	57,25
Agences du gouvernement américain	5,19	0,05
Obligations du Trésor américain	2,49	3,37
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	14,49	6,77
Titres adossés à des actifs	15,94	9,48
Émissions souveraines	7,09	9,12
Titres privilégiés	0,30	0,26
Instruments à court terme	6,75	2,50
Fonds d'investissement	8,90	6,61
Contrats de mise en pension	2,08	2,95
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,34	0,47
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	S/O	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection	(0,21)	S/O
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,01	0,01
Swaps de taux d'intérêt	0,18	(0,25)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,48	0,23
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	S/O	0,00
Options de change	S/O	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(1,25)	(1,09)
Options sur titres	S/O	0,00
Contrats de change à terme	0,19	(0,14)
Autres actifs et passifs à court terme	(2,29)	2,41
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
ARGENTINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement argentin				
0,500 % éch. 09/07/2030	$	254	$ 63	0,01
1,000 % éch. 09/07/2029		3	1	0,00
1,500 % éch. 09/07/2035		91	21	0,01
Total Argentine			85	0,02
AUSTRALIE				
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Pepper Residential Securities Trust				
4,210 % éch. 16/09/2059	AUD	366	247	0,06
RESIMAC Bastille Trust				
5,102 % éch. 05/09/2057	$	112	112	0,03
			359	0,09
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement australien				
0,500 % éch. 21/09/2026	AUD	4 100	2 484	0,60
0,750 % éch. 21/11/2027		3 822	1 610	0,39
1,000 % éch. 21/12/2030		700	379	0,09
1,250 % éch. 21/05/2032		500	266	0,06
1,750 % éch. 21/06/2051		700	275	0,07
2,500 % éch. 21/05/2030		500	309	0,08
4,500 % éch. 21/04/2033		2 100	1 478	0,36
			6 801	1,65
Total Australie			7 160	1,74
BRÉSIL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Bradesco S.A.				
2,850 % éch. 27/01/2023	$	500	499	0,12
Odebrecht Oil & Gas Finance Ltd.				
0,000 % éch. 30/01/2023 (c)(f)		254	1	0,00
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL				
9,850 % éch. 16/07/2032	BRL	15 566	2 602	0,64
Total Brésil			3 102	0,76
CANADA				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Air Canada Pass-Through Trust				
3,300 % éch. 15/07/2031	$	398	341	0,08
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
2,750 % éch. 29/03/2028	€	500	467	0,12
			808	0,20
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Real Estate Asset Liquidity Trust				
3,072 % éch. 12/08/2053	CAD	351	257	0,06
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien				
1,500 % éch. 01/12/2044 (e)		2 527	1 942	0,47
Total Canada			3 007	0,73
ÎLES CAÏMANS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				
5,169 % éch. 15/01/2031	$	1 080	1 060	0,26
5,229 % éch. 16/01/2030		1 238	1 225	0,30
Babson CLO Ltd.				
5,233 % éch. 20/01/2031		1 200	1 181	0,29
Bain Capital Credit CLO				
5,285 % éch. 23/04/2031		1 200	1 176	0,29
Barings CLO Ltd.				
5,043 % éch. 20/01/2028		1 119	1 114	0,27
CBAM CLO Ltd.				
5,099 % éch. 17/04/2031		1 300	1 277	0,31
CIFC Funding Ltd.				
5,194 % éch. 18/04/2031		1 500	1 474	0,36
Dryden CLO Ltd.				
5,099 % éch. 15/04/2031		1 400	1 383	0,34
Dryden Senior Loan Fund				
5,806 % éch. 15/08/2030	$	1 294	$ 1 281	0,31
Gallatin CLO Ltd.				
5,328 % éch. 21/01/2028		502	498	0,12
LCM LP				
5,283 % éch. 20/07/2031		1 300	1 281	0,31
Madison Park Funding Ltd.				
4,829 % éch. 15/04/2029		1 244	1 231	0,30
OCP CLO Ltd.				
5,363 % éch. 20/07/2029		1 126	1 116	0,27
Octagon Investment Partners Ltd.				
5,039 % éch. 16/04/2031		1 100	1 085	0,26
Octagon Loan Funding Ltd.				
5,854 % éch. 18/11/2031		1 300	1 282	0,31
Venture CLO Ltd.				
4,959 % éch. 15/04/2027		273	273	0,07
5,293 % éch. 20/07/2030		1 299	1 269	0,31
5,343 % éch. 20/01/2029		966	955	0,23
Wind River CLO Ltd.				
5,244 % éch. 18/07/2031		1 295	1 267	0,31
			21 428	5,22
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
KSA Sukuk Ltd.				
5,268 % éch. 25/10/2028		400	416	0,10
Odebrecht Offshore Drilling Finance Ltd. (6,720 % en numéraire et 1,000 % de rémunération en nature)				
7,720 % éch. 01/12/2026 ^(b)		2 215	592	0,15
QNB Finance Ltd.				
1,375 % éch. 26/01/2026		400	359	0,09
S.A. Global Sukuk Ltd.				
2,694 % éch. 17/06/2031		400	343	0,08
Sands China Ltd.				
4,300 % éch. 08/01/2026		200	185	0,05
5,625 % éch. 08/08/2025		400	383	0,09
			2 278	0,56
Total îles Caïmans			23 706	5,78
CHILI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Santander Chile				
2,700 % éch. 10/01/2025		1 100	1 045	0,25
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos				
4,500 % éch. 01/03/2026	CLP	1 120 000	1 259	0,31
Total Chili			2 304	0,56
COLOMBIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
TES colombien				
5,750 % éch. 03/11/2027	COP	570 000	89	0,02
RÉPUBLIQUE TCHÈQUE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de République tchèque				
0,950 % éch. 15/05/2030	CZK	12 100	402	0,10
DANEMARK				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Jyske Realkredit A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	18 862	1 953	0,48
1,500 % éch. 01/10/2037		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		1 171	130	0,03
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
1,000 % éch. 01/10/2050		44 476	4 451	1,08
1,500 % éch. 01/10/2037		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		790	83	0,02
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	23 828	$ 2 473	0,60
1,000 % éch. 01/10/2053		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2037		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		10 615	1 120	0,27
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/10/2036		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
3,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050		3 674	389	0,10
1,500 % éch. 01/10/2053		3 352	360	0,09
2,500 % éch. 01/04/2036		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/04/2047		0	0	0,00
Total Danemark			10 959	2,67
RÉPUBLIQUE DOMINICAINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine				
6,500 % éch. 15/02/2048	$	800	662	0,16
FRANCE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BNP Paribas S.A.				
1,675 % éch. 30/06/2027		900	784	0,19
2,591 % éch. 20/01/2028		1 000	881	0,22
3,800 % éch. 10/01/2024		300	295	0,07
Société Générale S.A.				
1,488 % éch. 14/12/2026		3 700	3 220	0,78
			5 180	1,26
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement français				
0,100 % éch. 25/07/2031 (e)	€	1 725	1 763	0,43
0,250 % éch. 25/07/2024 (e)		1 836	1 974	0,48
0,500 % éch. 25/05/2072		100	40	0,01
0,750 % éch. 25/05/2052		3 550	2 001	0,49
1,500 % éch. 25/05/2050		600	433	0,11
3,250 % éch. 25/05/2045		200	210	0,05
			6 421	1,57
Total France			11 601	2,83
ALLEMAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Deutsche Bank AG				
0,050 % éch. 20/11/2024		3 800	3 807	0,93
1,000 % éch. 19/11/2025		100	100	0,02
1,375 % éch. 03/09/2026		400	389	0,10
1,375 % éch. 17/02/2032		400	312	0,08
1,625 % éch. 20/01/2027		2 500	2 357	0,57
1,750 % éch. 19/11/2030		400	336	0,08
2,625 % éch. 12/02/2026		500	504	0,12
3,035 % éch. 28/05/2032 (i)	$	1 050	798	0,19
IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % en numéraire ou 4,375 % de rémunération en nature)				
3,625 % éch. 15/05/2025 (b)	€	700	683	0,17
IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % en numéraire ou 4,625 % de rémunération en nature)				
3,875 % éch. 15/05/2027 (b)		300	272	0,07
Total Allemagne			9 558	2,33
GUATEMALA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement du Guatemala				
5,375 % éch. 24/04/2032	$	400	394	0,10
HONG KONG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Huarong Finance Co. Ltd.				
2,125 % éch. 30/09/2023		400	385	0,09
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.				
6,307 % éch. 25/05/2023		500	497	0,12
Total Hong Kong			882	0,21

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
HONGRIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement hongrois				
5,000 % éch. 22/02/2027	€	100	$ 106	0,03
INDONÉSIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara				
3,000 % éch. 30/06/2030	$	3 500	2 877	0,70
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement indonésien				
8,375 % éch. 15/03/2034	IDR	22 982 000	1 623	0,40
Total Indonésie			4 500	1,10
IRLANDE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Accunia European CLO DAC				
2,328 % éch. 15/07/2030	€	535	560	0,14
Ares European CLO DAC				
2,158 % éch. 15/10/2031		1 100	1 138	0,28
Armada Euro CLO DAC				
2,098 % éch. 15/07/2031		400	415	0,10
Aurium CLO DAC				
2,108 % éch. 16/01/2031		1 100	1 148	0,28
BNPP AM Euro CLO DAC				
2,322 % éch. 22/07/2032		1 000	1 034	0,25
Cairn CLO DAC				
2,178 % éch. 30/04/2031		395	411	0,10
Carlyle Euro CLO DAC				
2,078 % éch. 15/01/2031		1 000	1 041	0,25
Dryden Euro CLO DAC				
2,038 % éch. 15/04/2033		700	725	0,18
2,622 % éch. 15/05/2034		1 000	1 037	0,25
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				
2,356 % éch. 20/01/2032		1 000	1 032	0,25
Harvest CLO DAC				
2,136 % éch. 20/10/2031		800	829	0,20
2,138 % éch. 15/07/2031		1 100	1 134	0,28
2,228 % éch. 15/01/2032		1 100	1 137	0,28
2,433 % éch. 18/11/2029		281	296	0,07
2,775 % éch. 26/06/2030		1 062	1 108	0,27
Jubilee CLO DAC				
1,978 % éch. 15/04/2030		600	627	0,15
2,028 % éch. 15/04/2031		400	415	0,10
Madison Park Euro Funding DAC				
2,178 % éch. 15/07/2032		1 100	1 138	0,28
Man GLG Euro CLO DAC				
2,188 % éch. 15/10/2032		1 099	1 135	0,28
2,736 % éch. 15/12/2031		600	621	0,15
Oak Hill European Credit Partners DAC				
2,196 % éch. 20/10/2031		1 100	1 139	0,28
OCP Euro CLO DAC				
2,382 % éch. 22/09/2034		800	830	0,20
Palmer Square European Loan Funding DAC				
2,108 % éch. 15/07/2031		1 002	1 041	0,25
Sculptor European CLO DAC				
2,153 % éch. 14/01/2032		1 100	1 142	0,28
			21 133	5,15
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AerCap Ireland Capital DAC				
2,450 % éch. 29/10/2026	$	400	350	0,09
3,000 % éch. 29/10/2028		500	420	0,10
			770	0,19
Total Irlande			21 903	5,34
ISRAËL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Israel Electric Corp. Ltd.				
3,750 % éch. 22/02/2032		1 200	1 055	0,26

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement israélien				
1,500 % éch. 30/11/2023	ILS	6 000	$ 1 669	0,41
1,750 % éch. 31/08/2025		2 100	566	0,14
2,000 % éch. 31/03/2027		2 700	715	0,17
			2 950	0,72
Total Israël			4 005	0,98
ITALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AMCO - Asset Management Co. SpA				
1,500 % éch. 17/07/2023	€	1 000	1 057	0,26
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
0,875 % éch. 08/10/2027		1 300	1 233	0,30
UniCredit SpA				
7,830 % éch. 04/12/2023	$	1 100	1 112	0,27
			3 402	0,83
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
2,350 % éch. 15/09/2024 (e)	€	23 130	25 439	6,20
Obligation internationale du gouvernement italien				
6,000 % éch. 04/08/2028	£	1 000	1 215	0,29
			26 654	6,49
Total Italie			30 056	7,32
CÔTE D'IVOIRE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire				
5,250 % éch. 22/03/2030	€	1 600	1 448	0,35
JAPON				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nissan Motor Co. Ltd.				
4,345 % éch. 17/09/2027	$	500	454	0,11
4,810 % éch. 17/09/2030		400	340	0,08
Nomura Holdings, Inc.				
2,329 % éch. 22/01/2027		400	351	0,09
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
0,409 % éch. 07/11/2029	€	1 300	1 120	0,27
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
0,010 % éch. 15/10/2027		1 000	900	0,22
			3 165	0,77
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Japan Finance Organization for Municipalities				
3,375 % éch. 27/09/2023	$	1 400	1 382	0,33
Obligation internationale du gouvernement japonais				
0,100 % éch. 10/03/2028 (e)	¥	754 474	5 915	1,44
0,100 % éch. 10/03/2029 (e)		520 325	4 093	1,00
0,500 % éch. 20/03/2049		268 000	1 591	0,39
0,700 % éch. 20/06/2051		254 000	1 547	0,38
Gouvernement de la métropole de Tokyo				
2,625 % éch. 29/05/2024	$	400	387	0,09
			14 915	3,63
Total Japon			18 080	4,40
LUXEMBOURG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Aroundtown S.A.				
0,375 % éch. 15/04/2027	€	700	496	0,12
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund				
0,900 % éch. 12/10/2029		300	234	0,06
CPI Property Group S.A.				
1,625 % éch. 23/04/2027		700	534	0,13
1,750 % éch. 14/01/2030		300	195	0,05
Logicor Financing SARL				
0,625 % éch. 17/11/2025		200	183	0,04
0,750 % éch. 15/07/2024		600	588	0,14
			2 230	0,54

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Miravet SARL				
2,758 % éch. 26/05/2065	€	521	$ 537	0,13
Total Luxembourg			2 767	0,67
MALAISIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Petronas Capital Ltd.				
2,480 % éch. 28/01/2032	$	500	415	0,10
3,500 % éch. 21/04/2030		200	183	0,05
4,550 % éch. 21/04/2050		200	179	0,04
4,800 % éch. 21/04/2060		200	184	0,05
			961	0,24
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement malaisien				
3,480 % éch. 15/03/2023	MYR	13 000	2 954	0,72
Émission d'investissement du gouvernement malaisien				
3,151 % éch. 15/05/2023		400	91	0,02
			3 045	0,74
Total Malaisie			4 006	0,98
MEXIQUE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Petroleos Mexicanos				
6,750 % éch. 21/09/2047	$	1 809	1 158	0,28
MAROC				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement marocain				
2,000 % éch. 30/09/2030 (j)	€	1 800	1 525	0,37
MULTINATIONALES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Preferred Term Securities Ltd.				
5,138 % éch. 23/06/2035	$	1 063	1 009	0,25
PAYS-BAS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Cooperatieve Rabobank UA				
3,758 % éch. 06/04/2033		400	342	0,08
CTP NV				
0,500 % éch. 21/06/2025	€	1 100	986	0,24
Enel Finance International NV				
2,650 % éch. 10/09/2024	$	1 200	1 149	0,28
ING Groep NV				
2,125 % éch. 23/05/2026	€	500	508	0,12
3,875 % éch. 16/05/2027 (f)(h)	$	200	147	0,04
Prosus NV				
1,207 % éch. 19/01/2026	€	1 500	1 446	0,35
3,257 % éch. 19/01/2027	$	1 600	1 432	0,35
			6 010	1,46
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Jubilee Place BV				
2,378 % éch. 17/10/2057	€	493	522	0,13
Total Pays-Bas			6 532	1,59
NOUVELLE-ZÉLANDE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais				
1,500 % éch. 15/05/2031	NZD	600	302	0,07
NORVÈGE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Kommunalbanken A/S				
1,900 % éch. 19/01/2027	AUD	400	245	0,06
Obligation internationale du gouvernement norvégien				
1,750 % éch. 13/03/2025	NOK	6 000	592	0,14
Total Norvège			837	0,20

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
PÉROU				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % éch. 17/09/2024	PEN	1 700	$ 416	0,10
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement péruvien				
5,400 % éch. 12/08/2034		1 600	337	0,08
5,940 % éch. 12/02/2029		9 400	2 263	0,55
6,150 % éch. 12/08/2032		1 200	277	0,07
6,350 % éch. 12/08/2028		12 100	3 019	0,74
8,200 % éch. 12/08/2026		2 100	577	0,14
			6 473	1,58
Total Pérou			6 889	1,68
PHILIPPINES				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement philippin				
6,250 % éch. 14/01/2036	PHP	21 000	344	0,08
POLOGNE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement polonais				
5,500 % éch. 16/11/2027	$	100	103	0,03
PORTUGAL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Espirito Santo S.A.				
4,000 % éch. 21/01/2019 ^	€	1 900	294	0,07
4,750 % éch. 15/01/2018 ^		600	93	0,02
Total Portugal			387	0,09
QATAR				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
QatarEnergy Trading LLC				
2,250 % éch. 12/07/2031	$	200	166	0,04
3,300 % éch. 12/07/2051		200	148	0,04
Total Qatar			314	0,08
ROUMANIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement roumain				
1,375 % éch. 02/12/2029	€	360	281	0,07
1,750 % éch. 13/07/2030		1 300	969	0,24
2,000 % éch. 28/01/2032		100	72	0,02
2,000 % éch. 14/04/2033		800	549	0,13
2,124 % éch. 16/07/2031		300	222	0,05
2,625 % éch. 02/12/2040		100	60	0,02
2,750 % éch. 14/04/2041		200	120	0,03
2,875 % éch. 13/04/2042		500	300	0,07
Total Roumanie			2 573	0,63
RUSSIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement russe				
1,125 % éch. 20/11/2027 ^		2 000	619	0,15
4,750 % éch. 27/05/2026 ^	$	200	70	0,02
7,700 % éch. 23/03/2033	RUB	33 500	142	0,03
Total Russie			831	0,20
SERBIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement serbe				
3,125 % éch. 15/05/2027	€	3 900	3 591	0,88
SINGAPOUR				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
CapitaLand Ascendas REIT				
0,750 % éch. 23/06/2028		1 000	836	0,20

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
SLOVÉNIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % éch. 27/01/2025	€	400	$ 387	0,09
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % éch. 05/02/2030		400	355	0,09
Total Slovénie			742	0,18
AFRIQUE DU SUD				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement sud-africain				
5,375 % éch. 24/07/2044	$	300	227	0,05
5,750 % éch. 30/09/2049		200	148	0,04
Total Afrique du Sud			375	0,09
CORÉE DU SUD				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen				
2,125 % éch. 10/06/2027	KRW	680 000	501	0,12
2,375 % éch. 10/12/2028		2 960 000	2 171	0,53
5,500 % éch. 10/03/2028		640 000	547	0,13
Total Corée du Sud			3 219	0,78
ESPAGNE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
BBVA Consumer Auto				
0,270 % éch. 20/07/2031	€	226	236	0,06
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Santander S.A.				
1,849 % éch. 25/03/2026	$	200	177	0,04
3,496 % éch. 24/03/2025		800	771	0,19
CaixaBank S.A.				
1,750 % éch. 24/10/2023	€	600	633	0,15
			1 581	0,38
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Communauté autonome de Catalogne				
4,220 % éch. 26/04/2035		300	311	0,08
Obligation internationale du gouvernement espagnol				
1,450 % éch. 31/10/2071		500	245	0,06
3,450 % éch. 30/07/2066		2 000	1 888	0,46
			2 444	0,60
Total Espagne			4 261	1,04
SUPRANATIONALES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banque de développement asiatique				
6,150 % éch. 25/02/2030	INR	252 300	2 925	0,71
SUISSE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Credit Suisse AG				
6,500 % éch. 08/08/2023 (h)	$	1 400	1 359	0,33
Credit Suisse Group AG				
3,800 % éch. 09/06/2023		1 000	974	0,24
6,537 % éch. 12/08/2033		300	264	0,06
7,375 % éch. 07/09/2033	£	400	439	0,11
7,500 % éch. 17/07/2023 (f)(h)	$	300	240	0,06
7,750 % éch. 01/03/2029	€	1 700	1 808	0,44
UBS Group AG				
4,125 % éch. 24/09/2025	$	200	195	0,05
4,703 % éch. 05/08/2027		1 500	1 452	0,35
Total Suisse			6 731	1,64
THAÏLANDE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais				
3,390 % éch. 17/06/2037	THB	13 580	408	0,10
3,450 % éch. 17/06/2043		22 200	651	0,16
Total Thaïlande			1 059	0,26

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÉMIRATS ARABES UNIS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
MDGH GMTN RSC Ltd.				
5,500 % éch. 28/04/2033	$	200	$ 212	0,05
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Antofagasta PLC				
2,375 % éch. 14/10/2030		400	322	0,08
Barclays PLC				
7,750 % éch. 15/09/2023 (f)(h)		500	489	0,12
GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC				
3,125 % éch. 24/03/2025		700	666	0,16
HSBC Holdings PLC				
2,251 % éch. 22/11/2027		400	347	0,08
3,350 % éch. 16/02/2024	AUD	700	474	0,12
4,041 % éch. 13/03/2028	$	200	185	0,05
4,150 % éch. 16/02/2024	AUD	1 700	1 152	0,28
4,583 % éch. 19/06/2029	$	1 000	922	0,23
5,674 % éch. 18/05/2024		800	797	0,19
Nationwide Building Society				
2,972 % éch. 16/02/2028		1 300	1 144	0,28
NatWest Group PLC				
5,076 % éch. 27/01/2030		1 100	1 038	0,25
Santander UK Group Holdings PLC				
2,469 % éch. 11/01/2028		500	428	0,10
4,750 % éch. 15/09/2025		1 100	1 049	0,26
Standard Chartered PLC				
0,991 % éch. 12/01/2025		800	756	0,18
2,608 % éch. 12/01/2028		200	174	0,04
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % éch. 18/11/2028	£	400	355	0,09
			10 298	2,51
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Alba PLC				
3,714 % éch. 17/03/2039		908	1 030	0,25
Avon Finance PLC				
4,331 % éch. 20/09/2048		590	697	0,17
Canada Square Funding PLC				
4,205 % éch. 17/06/2058		710	822	0,20
Eurosail PLC				
2,165 % éch. 13/03/2045	€	23	25	0,01
3,661 % éch. 13/03/2045	£	254	301	0,07
Finsbury Square PLC				
4,709 % éch. 16/06/2070		437	525	0,13
Great Hall Mortgages PLC				
3,675 % éch. 18/03/2039		27	32	0,01
3,685 % éch. 18/06/2039		222	260	0,06
4,868 % éch. 18/06/2039	$	152	149	0,04
Paragon Mortgages PLC				
4,290 % éch. 15/05/2045	£	219	262	0,06
Polaris PLC				
4,222 % éch. 23/12/2058		860	1 009	0,24
Resloc UK PLC				
3,682 % éch. 15/12/2043		504	579	0,14
Ripon Mortgages PLC				
4,011 % éch. 28/08/2056		3 358	3 965	0,97
RMAC PLC				
4,206 % éch. 12/06/2046		731	875	0,21
4,476 % éch. 12/06/2046		740	887	0,22
RMAC Securities PLC				
3,676 % éch. 12/06/2044		581	640	0,16
Stratton Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2060		1 386	1 653	0,40
4,287 % éch. 12/03/2052		613	734	0,18
4,292 % éch. 25/09/2051		974	1 156	0,28
Towd Point Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2045		1 075	1 279	0,31
Tower Bridge Funding PLC				
4,801 % éch. 20/09/2063		339	407	0,10
Trinity Square PLC				
3,729 % éch. 15/07/2059		648	770	0,19
			18 057	4,40

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
TITRES PRIVILÉGIÉS			
Nationwide Building Society			
10,250 %	2 030	$ 306	0,07

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Bon du Trésor britannique			
0,125 % éch. 22/03/2024 (e)	£ 5 286	6 463	1,58
0,625 % éch. 22/10/2050	1 300	699	0,17
1,250 % éch. 31/07/2051	1 700	1 106	0,27
1,500 % éch. 31/07/2053	300	207	0,05
		8 475	2,07
Total Royaume-Uni		37 136	9,05
ÉTATS-UNIS			
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS			
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
4,669 % éch. 25/07/2036	$ 93	74	0,02
4,989 % éch. 25/02/2036	150	147	0,04
5,049 % éch. 25/11/2035	222	222	0,05
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
3,644 % éch. 25/07/2036	15	15	0,00
Carrington Mortgage Loan Trust			
4,609 % éch. 25/01/2037	1 100	795	0,19
Citigroup Mortgage Loan Trust			
4,249 % éch. 25/10/2037	551	509	0,12
4,909 % éch. 25/03/2036	1 088	968	0,24
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
4,529 % éch. 25/08/2037 ^	822	711	0,17
4,529 % éch. 25/06/2047 ^	246	218	0,05
4,589 % éch. 25/06/2047 ^	1 006	861	0,21
4,619 % éch. 25/04/2047	1 300	1 172	0,29
4,709 % éch. 25/05/2036	30	37	0,01
4,909 % éch. 25/12/2036 ^	3 217	2 987	0,73
First Franklin Mortgage Loan Trust			
5,109 % éch. 25/11/2035	107	98	0,02
First NLC Trust			
4,459 % éch. 25/08/2037	398	189	0,05
GSAMP Trust			
4,539 % éch. 25/12/2046	189	95	0,02
4,619 % éch. 25/12/2046	94	47	0,01
4,869 % éch. 25/09/2036	3 136	1 161	0,28
Home Equity Asset Trust			
5,484 % éch. 25/05/2035	476	467	0,11
HSI Asset Securitization Corp. Trust			
4,729 % éch. 25/12/2036	202	55	0,01
5,004 % éch. 25/01/2036	2 300	2 164	0,53
Long Beach Mortgage Loan Trust			
5,034 % éch. 25/11/2035	60	59	0,01
Massachusetts Educational Financing Authority			
5,308 % éch. 25/04/2038	40	40	0,01
MASTR Asset-Backed Securities Trust			
4,599 % éch. 25/05/2037	310	292	0,07
4,689 % éch. 25/08/2036	290	118	0,03
4,869 % éch. 25/06/2036	3 667	1 469	0,36
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
4,519 % éch. 25/10/2036	672	592	0,14
4,519 % éch. 25/01/2037	1 963	973	0,24
4,639 % éch. 25/03/2037	710	321	0,08
4,869 % éch. 25/06/2036	1 375	729	0,18
New Century Home Equity Loan Trust			
5,109 % éch. 25/03/2035	377	360	0,09
NovaStar Mortgage Funding Trust			
4,689 % éch. 25/09/2036	201	88	0,02
Option One Mortgage Loan Trust			
4,529 % éch. 25/03/2037	339	303	0,07
RAAC Trust			
5,889 % éch. 25/09/2047	403	386	0,09
Residential Asset Mortgage Products Trust			
5,029 % éch. 25/01/2036	354	332	0,08
5,439 % éch. 25/09/2035	1 300	1 134	0,28
Residential Asset Securities Corp. Trust			
4,949 % éch. 25/04/2036	59	58	0,01
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
4,889 % éch. 25/05/2036	414	225	0,06
5,049 % éch. 25/08/2035 ^	$ 631	$ 480	0,12
5,349 % éch. 25/01/2036 ^	35	33	0,01
SMB Private Education Loan Trust			
1,290 % éch. 15/07/2053	490	433	0,11
5,418 % éch. 15/07/2053	147	143	0,04
Soundview Home Loan Trust			
4,949 % éch. 25/05/2036	569	544	0,13
Structured Asset Investment Loan Trust			
4,539 % éch. 25/09/2036	33	32	0,01
5,009 % éch. 25/01/2036	2 038	1 828	0,45
5,439 % éch. 25/08/2033	9	9	0,00
		23 973	5,84
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
7-Eleven, Inc.			
0,625 % éch. 10/02/2023	1 400	1 393	0,34
0,800 % éch. 10/02/2024	100	95	0,02
American Tower Corp.			
3,800 % éch. 15/08/2029	500	455	0,11
Bank of America Corp.			
1,949 % éch. 27/10/2026	€ 700	702	0,17
2,551 % éch. 04/02/2028	$ 400	356	0,09
2,863 % éch. 24/08/2025	€ 600	638	0,16
2,972 % éch. 04/02/2033	$ 400	323	0,08
3,384 % éch. 02/04/2026	600	574	0,14
4,376 % éch. 27/04/2028	400	383	0,09
Bayer U.S. Finance LLC			
4,250 % éch. 15/12/2025	400	388	0,09
4,375 % éch. 15/12/2028	200	188	0,05
5,779 % éch. 15/12/2023	900	898	0,22
Boeing Co.			
1,167 % éch. 04/02/2023	100	100	0,02
1,433 % éch. 04/02/2024	700	671	0,16
2,750 % éch. 01/02/2026	1 000	928	0,23
3,250 % éch. 01/02/2028	200	182	0,04
Broadcom, Inc.			
2,450 % éch. 15/02/2031	500	395	0,10
2,600 % éch. 15/02/2033	300	226	0,05
3,469 % éch. 15/04/2034	400	320	0,08
Charter Communications Operating LLC			
2,250 % éch. 15/01/2029	1 100	887	0,22
3,950 % éch. 30/06/2062	800	475	0,12
5,125 % éch. 01/07/2049	500	380	0,09
Citigroup, Inc.			
3,785 % éch. 17/03/2033 (i)	1 300	1 115	0,27
Corebridge Financial, Inc.			
3,650 % éch. 05/04/2027	300	280	0,07
Doctors Co. An Interinsurance Exchange			
4,500 % éch. 18/01/2032	100	81	0,02
Energy Transfer LP			
5,250 % éch. 15/04/2029	400	388	0,09
Fidelity National Information Services, Inc.			
0,750 % éch. 21/05/2023	€ 500	530	0,13
Ford Motor Credit Co. LLC			
1,744 % éch. 19/07/2024	100	102	0,02
2,748 % éch. 14/06/2024	£ 100	114	0,03
3,021 % éch. 06/03/2024	€ 400	419	0,10
3,375 % éch. 13/11/2025	$ 500	453	0,11
3,664 % éch. 08/09/2024	200	191	0,05
5,125 % éch. 16/06/2025	500	482	0,12
GA Global Funding Trust			
2,250 % éch. 06/01/2027	300	264	0,06
Goldman Sachs Group, Inc.			
0,010 % éch. 30/04/2024	€ 800	844	0,21
1,250 % éch. 07/02/2029	600	534	0,13
1,757 % éch. 24/01/2025	$ 400	383	0,09
2,732 % éch. 07/02/2025	€ 500	532	0,13
3,615 % éch. 15/03/2028	$ 700	653	0,16
4,223 % éch. 01/05/2029	200	187	0,05
Hyatt Hotels Corp.			
1,300 % éch. 01/10/2023	300	292	0,07
JPMorgan Chase & Co.			
2,595 % éch. 24/02/2026	1 300	1 223	0,30
4,080 % éch. 26/04/2026	1 300	1 263	0,31
4,912 % éch. 25/07/2033	300	287	0,07
Morgan Stanley			
2,103 % éch. 08/05/2026	€ 1 000	1 018	0,25
ONEOK, Inc.			
4,550 % éch. 15/07/2028	$ 300	$ 284	0,07
Organon & Co.			
2,875 % éch. 30/04/2028	€ 100	94	0,02
5,125 % éch. 30/04/2031	$ 300	260	0,06
Pacific Gas & Electric Co.			
2,100 % éch. 01/08/2027	100	86	0,02
3,150 % éch. 01/01/2026	100	93	0,02
3,450 % éch. 01/07/2025	100	95	0,02
3,950 % éch. 01/12/2047 ^	100	68	0,02
4,000 % éch. 01/12/2046 ^	100	67	0,02
4,200 % éch. 01/03/2029	300	268	0,06
4,500 % éch. 01/07/2040	100	78	0,02
4,550 % éch. 01/07/2030	100	91	0,02
Penske Truck Leasing Co. LP			
3,950 % éch. 10/03/2025	1 400	1 350	0,33
Principal Life Global Funding			
1,375 % éch. 10/01/2025	300	278	0,07
Rio Oil Finance Trust			
9,250 % éch. 06/07/2024	463	470	0,11
Southern California Edison Co.			
1,100 % éch. 01/04/2024	300	285	0,07
4,963 % éch. 03/04/2023	400	399	0,10
Wells Fargo & Co.			
3,526 % éch. 24/03/2028	900	835	0,20
		27 693	6,74
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			
CenturyLink, Inc.			
6,634 % éch. 15/03/2027	598	569	0,14
OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX			
Obligations American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010			
7,334 % éch. 15/02/2028	1 300	1 387	0,34
Billets Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021			
1,337 % éch. 01/06/2023	500	493	0,12
		1 880	0,46
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Ashford Hospitality Trust			
5,218 % éch. 15/04/2035	1 288	1 246	0,30
5,318 % éch. 15/06/2035	1 300	1 253	0,31
Banc of America Funding Trust			
4,733 % éch. 20/10/2036	49	36	0,01
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust			
5,318 % éch. 15/07/2037	1 361	1 325	0,32
Chase Mortgage Finance Trust			
3,718 % éch. 25/07/2037	40	33	0,01
Citigroup Commercial Mortgage Trust			
3,251 % éch. 10/05/2035	1 000	938	0,23
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
2,910 % éch. 25/05/2035	23	22	0,01
Countrywide Alternative Loan Trust			
4,773 % éch. 20/03/2046	21	17	0,00
4,773 % éch. 20/05/2046 ^	25	21	0,01
6,000 % éch. 25/03/2036 ^	389	184	0,05
6,000 % éch. 25/05/2037 ^	196	96	0,02
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
5,009 % éch. 25/03/2035	266	227	0,06
DBWF Mortgage Trust			
5,469 % éch. 19/12/2030	1 200	1 166	0,28
GSR Mortgage Loan Trust			
5,750 % éch. 25/02/2036	156	137	0,03
HarborView Mortgage Loan Trust			
3,764 % éch. 19/06/2036 ^	177	83	0,02
Lehman XS Trust			
4,909 % éch. 25/02/2046 ^	196	170	0,04
Morgan Stanley Capital Trust			
5,218 % éch. 15/07/2035	1 300	1 275	0,31
Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
6,000 % éch. 25/06/2036	286	231	0,06
6,000 % éch. 25/09/2036 ^	284	126	0,03
Residential Asset Securitization Trust			
5,750 % éch. 25/02/2036	979	752	0,18

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Sequoia Mortgage Trust				
2,976 % éch. 20/01/2047 ^	$	17	$ 11	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,658 % éch. 25/10/2036 ^		64	38	0,01
4,709 % éch. 25/10/2035		155	142	0,03
4,829 % éch. 25/05/2037		27	24	0,01
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
4,749 % éch. 25/07/2046		463	379	0,09
4,789 % éch. 25/05/2036		202	155	0,04
4,809 % éch. 25/04/2036		17	14	0,00
5,179 % éch. 19/10/2033		2	2	0,00
Structured Asset Securities Corp.				
4,669 % éch. 25/01/2036		141	135	0,03
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
4,679 % éch. 25/10/2036		514	451	0,11
Tharaldson Hotel Portfolio Trust				
5,268 % éch. 11/11/2034		1 296	1 261	0,31
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,448 % éch. 25/06/2042		1	1	0,00
3,600 % éch. 25/12/2036 ^		64	55	0,01
4,949 % éch. 25/11/2045		132	115	0,03
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
6,000 % éch. 25/06/2037 ^		409	396	0,10
			12 517	3,05
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Fannie Mae				
3,000 % éch. 01/03/2060		453	400	0,10
3,500 % éch. 01/01/2059		1 342	1 233	0,30
4,789 % éch. 25/06/2036		18	17	0,00
Freddie Mac				
0,000 % éch. 15/01/2038 (a)		280	10	0,00
3,358 % éch. 15/01/2038		280	280	0,07
Ginnie Mae				
3,000 % éch. 20/07/2046 - 20/05/2047		10	9	0,00
4,182 % éch. 20/12/2062		383	379	0,09

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)				
2,500 % éch. 01/02/2051 - 01/01/2052	$	2 015	$ 1 712	0,42
3,000 % éch. 01/10/2042 - 01/10/2049		1 588	1 416	0,35
3,500 % éch. 01/10/2034 - 01/07/2050		923	860	0,21
4,000 % éch. 01/09/2040 - 01/06/2050		538	512	0,12
4,500 % éch. 01/04/2041		62	62	0,02
5,500 % éch. 01/07/2037 - 01/04/2039		183	190	0,05
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				
2,500 % éch. 01/01/2053		6 400	5 421	1,32
3,000 % éch. 01/02/2053		21 000	18 451	4,50
3,500 % éch. 01/02/2053		10 600	9 637	2,35
4,000 % éch. 01/01/2053		15 100	14 163	3,45
4,500 % éch. 01/02/2053		23 300	22 431	5,47
6,000 % éch. 01/01/2053		3 100	3 144	0,77
			80 327	19 59
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Obligations du Trésor américain				
1,625 % éch. 15/11/2050		1 300	774	0,19
1,875 % éch. 15/02/2041		13 500	9 549	2,32
2,875 % éch. 15/05/2052		300	240	0,06
4,000 % éch. 15/11/2052		400	401	0,10
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e)				
0,125 % éch. 15/07/2030		1 976	1 770	0,43
0,125 % éch. 15/01/2031		1 145	1 017	0,25
0,125 % éch. 15/07/2031		1 223	1 082	0,26
0,125 % éch. 15/01/2032		3 870	3 393	0,83
0,250 % éch. 15/02/2050		1 159	783	0,19
0,500 % éch. 15/01/2028		9 906	9 319	2,27
0,625 % éch. 15/07/2032		718	658	0,16
0,750 % éch. 15/07/2028		2 018	1 923	0,47
Billets du Trésor américain				
2,875 % éch. 30/04/2025		9 300	9 002	2,19
			39 911	9,72
Total États-Unis			186 870	45,54

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BONS DU TRÉSOR HONGROIS				
18,250 % éch. 03/01/2023 (c)(d)	HUF	1 203 000	$ 3 206	0,78
BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN				
0,505 % éch. 08/02/2023 (c)(d)	ILS	9 900	2 796	0,68
0,746 % éch. 05/04/2023 (c)(d)		4 200	1 179	0,29
0,753 % éch. 05/04/2023 (c)(d)		6 700	1 881	0,46
0,875 % éch. 03/05/2023 (c)(d)		7 800	2 185	0,53
0,913 % éch. 05/04/2023 (c)(d)		2 300	646	0,16
0,950 % éch. 05/04/2023 (c)(d)		700	196	0,05
			8 883	2,17
Total des Instruments à court terme			12 089	2,95
Total des Valeurs mobilières			**$ 443 632**	**108,10**

DESCRIPTION	ACTIONS	VALEUR (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT				
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF				
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (g)	446 527		5 948	1,44
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	1 235 076		12 294	3,00
Total des Fonds d'investissement			**$ 18 242**	**4,44**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
FICC	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 1 408	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 29/06/2023	$ (1 436)	$ 1 408	$ 1 408	0,34
Total des Contrats de mise en pension						**$ (1 436)**	**$ 1 408**	**$ 1 408**	**0,34**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2024	390	$ 157	0,04
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Long	09/2023	235	(269)	(0,07)
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Long	09/2024	195	(63)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans mars	Court	03/2023	28	26	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars	Long	03/2023	64	(286)	(0,07)
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	4	3	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars	Court	03/2023	18	29	0,01
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Court	03/2023	209	785	0,19
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	Court	03/2023	219	1 169	0,29
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Long	03/2023	33	(302)	(0,07)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	Court	03/2023	5	136	0,03
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars	Court	03/2023	202	1 943	0,47
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Court	03/2023	13	265	0,06
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	4	(20)	(0,01)

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Court	03/2023	42	$ (11)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	290	(39)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	46	(12)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Court	03/2023	26	(2)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Long	03/2023	5	4	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	257	49	0,01
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Court	03/2023	123	904	0,22
				$ 4 466	1,09

(1) Option de style contrat à terme standardisé.

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Nbre de Contrats	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	$ 98,000	15/12/2023	7	$ (6)	$ (1)	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	7	(6)	(21)	(0,01)
				$ (12)	$ (22)	(0,01)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					**$ 4 444**	**1,08**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

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

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel(3)	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AT&T, Inc.	1,000 %	20/12/2023	$ 300	$ (3)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/06/2028	€ 700	(21)	(0,01)
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2025	$ 400	6	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2024	€ 200	8	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/06/2026	450	16	0,01
				$ 6	0,00

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

Indices/Tranches	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel(3)	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.EM-37 à 5 ans	(1,000) %	20/06/2027	$ 3 528	$ (111)	(0,03)
Indice CDX.IG-35 à 10 ans	(1,000)	20/12/2030	1 600	15	0,00
Indice CDX.IG-37 à 10 ans	(1,000)	20/12/2031	5 300	(14)	0,00
Indice CDX.IG-38 à 10 ans	(1,000)	20/06/2032	900	(9)	0,00
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	(1,000)	20/12/2027	2 400	(16)	0,00
Indice CDX.IG-39 à 10 ans	(1,000)	20/12/2032	31 300	(328)	(0,08)
Indice iTraxx Europe Main 38 à 10 ans	(1,000)	20/12/2032	€ 6 900	(160)	(0,04)
				$ (623)	(0,15)

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT - SWAPS DE BASE

Indice de taux variable à payer	Indice de taux variable à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,070 %	07/03/2024	$ 3 400	$ 2	0,00
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,088 %	06/09/2024	21 300	(4)	0,00
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,098 %	02/03/2023	4 600	7	0,00
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,102 %	04/10/2024	4 500	13	0,01
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,105 %	27/09/2024	10 300	3	0,00
				$ 21	0,01

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	0,010 %	07/02/2023	£ 17 800	$ (356)	(0,09)
À payer(4)	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2033	16 400	(163)	(0,04)
À payer(4)	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053	600	(13)	0,00
À payer(4)	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250	15/03/2028	3 200	(61)	(0,01)
À payer(4)	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,500	15/03/2025	900	(1)	0,00
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	5,500	15/12/2026	INR 666 500	308	0,07

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	5,750 %	16/03/2027	INR 666 520	$ (261)	(0,06)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250	21/09/2024	336 810	(10)	0,00
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250	16/03/2032	63 900	(49)	(0,01)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,500	21/09/2024	747 800	37	0,01
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,750	21/09/2024	631 500	41	0,01
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	7,000	21/09/2027	154 500	(37)	(0,01)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2028	¥ 250 000	(68)	(0,02)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	17/03/2031	230 000	(96)	(0,02)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,050	15/12/2031	440 000	(141)	(0,03)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	19/06/2039	280 000	287	0,07
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,800	15/06/2052	300 000	280	0,07
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/09/2031	SGD 400	16	0,00
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	2,500	21/09/2027	700	(12)	0,00
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	2,750	15/06/2027	3 200	(38)	(0,01)
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	2,750	21/09/2027	9 641	(87)	(0,02)
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	3,000	15/06/2027	1 900	(9)	0,00
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/12/2027	800	(4)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2027	$ 10 400	984	0,24
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2029	15 000	(970)	(0,24)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/12/2028	3 200	(428)	(0,10)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/06/2032	1 000	(184)	(0,04)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,430	31/03/2024	200	8	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,500	15/06/2052	290	(88)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,618	09/02/2029	1 600	(177)	(0,04)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024	10 740	(53)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027	41 800	1 623	0,39
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2029	3 100	149	0,04
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	4 250	(119)	(0,03)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2052	600	23	0,01
À recevoir[4]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,850	21/04/2024	21 900	372	0,09
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,888	22/03/2029	2 500	(242)	(0,06)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,175	21/04/2029	2 400	(195)	(0,05)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,209	31/03/2024	2 236	78	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,400	21/06/2024	600	(20)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,750	30/04/2029	1 800	95	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,817	30/04/2029	3 600	176	0,04
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,818	30/04/2029	3 100	152	0,04
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,819	30/04/2029	2 400	117	0,03
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,886	15/05/2032	7 000	(530)	(0,13)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,906	16/09/2052	600	(36)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,965	30/11/2026	36 200	1 213	0,30
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,968	30/06/2024	13 100	(352)	(0,09)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029	400	(12)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,100	09/09/2029	1 200	(32)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,454	30/06/2029	2 900	(32)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,898	30/06/2029	3 200	46	0,01
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,280	04/01/2027	BRL 1 600	36	0,01
À recevoir[4]	BBR-BBSW AUD à 3 mois	3,750	15/03/2024	AUD 49 500	47	0,01
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,220	03/03/2025	CAD 6 700	(391)	(0,10)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2025	2 600	(154)	(0,04)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2030	1 600	(126)	(0,03)
À recevoir	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,750	16/12/2046	1 400	171	0,04
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,900	18/12/2029	3 700	(317)	(0,08)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance		Montant notionnel		Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,283 %	14/02/2027	CHF	1 700	$	(103)	(0,03)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,294	10/02/2027		4 400		(252)	(0,06)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,300	15/02/2027		1 700		(102)	(0,02)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,343	16/05/2027		1 300		(84)	(0,02)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,500	15/09/2026		900		(74)	(0,02)
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	21/12/2027	CNY	69 500		101	0,02
À payer	ESTRON EUR composé-OIS à 3 mois	1,000	23/11/2024	€	9 400		(99)	(0,02)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,000	21/09/2027	KRW	8 108 560		(148)	(0,04)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,000	15/06/2032		876 900		(24)	(0,01)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/06/2032		580 900		(11)	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	0,528	17/03/2024	NZD	350		(11)	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,000	01/11/2023		12 400		(170)	(0,04)
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,000	15/12/2023		11 700		(170)	(0,04)
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,250	21/03/2028		2 600		(315)	(0,08)
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,750	15/06/2027		4 100		(57)	(0,01)
À payer[4]	BBR NZD à 3 mois	4,000	14/06/2024		24 900		(198)	(0,05)
À payer	STIBOR SEK à 3 mois	0,500	19/06/2024	SEK	12 700		(66)	(0,02)
À payer	STIBOR SEK à 3 mois	1,000	19/06/2029		16 100		(235)	(0,06)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,250	30/03/2023	$	1 200		(13)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,249	31/08/2024		9 500		752	0,18
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	15/12/2026		10 200		1 206	0,29
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,298	25/08/2024		8 100		649	0,16
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	18/12/2024		200		19	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	15/12/2028		9 900		(1 433)	(0,35)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,518	20/01/2029		800		(104)	(0,03)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	20/01/2029		2 300		(284)	(0,07)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	26/01/2029		500		(61)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,000	15/12/2051		2 000		(733)	(0,18)
À recevoir	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,250	17/06/2030	AUD	5 700		643	0,16
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,750	16/03/2027		1 900		(122)	(0,03)
À recevoir	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,750	16/06/2031		1 750		229	0,06
À payer[4]	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	15/09/2032		1 100		(16)	0,00
À payer[4]	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	15/03/2033		3 400		(38)	(0,01)
À payer[4]	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,500	15/09/2032		31 400		(314)	(0,08)
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	0,054	27/05/2050	€	200		49	0,01
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,064	17/11/2052		500		171	0,04
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,450	15/12/2035		300		94	0,02
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024		500		(22)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027		1 400		(144)	(0,04)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	11/05/2027		900		(92)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027		700		(70)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027		1 600		(141)	(0,03)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027		700		(62)	(0,02)
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2025		23 900		529	0,13
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028		33 100		(747)	(0,18)
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053		4 100		211	0,05
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033		51 200		(1 101)	(0,27)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	21/09/2037		1 400		(72)	(0,02)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	19/03/2027		6 650		(8)	0,00
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	15/03/2033		2 980		9	0,00
À recevoir	NIBOR NOK à 6 mois	1,635	18/03/2025	NOK	6 200		33	0,01
À recevoir	NIBOR NOK à 6 mois	1,993	12/11/2024		4 200		27	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	4,870	07/07/2025	MXN	41 500		(116)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,080	26/02/2025		10 500		(39)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,380	25/02/2025		12 300		(49)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,415	25/02/2025		300		(1)	0,00
À payer	IPC Royaume-Uni	3,700	15/04/2031	£	100		(20)	0,00
À payer	IPC Royaume-Uni	3,740	15/03/2031		800		(160)	(0,04)
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,333	15/09/2032		900		(12)	0,00
						$	(2 976)	(0,73)
Total des Instruments financiers dérivés compensés						**$**	**(3 572)**	**(0,87)**

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

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

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

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

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

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

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

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,180 %	11/01/2024	1 900	$ 54	$ 201	0,05

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Option de vente - Obligation internationale du gouvernement français hors cote, 0,750 % échéance 25/05/2052	€ 97,000	23/05/2025	800	$ 61	$ 327	0,08

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente - Indice iTraxx Europe 37 à 5 ans hors cote	Vente	3,000 %	15/03/2023	1 000	$ (2)	$ 0	0,00

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150 %	01/12/2023	1 300	$ (4)	$ (1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	01/12/2023	1 300	(4)	(10)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,310	11/01/2024	16 900	(56)	(279)	(0,07)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	19/01/2023	300	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,500	19/01/2023	300	(1)	(4)	0,00
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	11/04/2023	2 000	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	11/04/2023	2 000	(6)	(31)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	28/04/2023	1 200	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	28/04/2023	1 200	(2)	(17)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 25 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,451	23/05/2025	800	(62)	(306)	(0,08)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	23/01/2023	400	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,770	23/01/2023	400	(1)	(2)	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	19/01/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,500	19/01/2023	200	(1)	(2)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	12/01/2023	400	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	12/01/2023	400	(1)	(1)	0,00
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,150	09/01/2023	1 400	(5)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	09/01/2023	1 400	(5)	(8)	0,00
DUB	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	700	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	700	(4)	(10)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,790	08/04/2024	1 700	(13)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,790	08/04/2024	1 700	(13)	(20)	(0,01)
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	500	(3)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	500	(3)	(7)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	500	(3)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	500	(3)	(6)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	600	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	600	(4)	(7)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	600	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	600	(4)	(7)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	500	(3)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	500	(3)	(6)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	600	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	600	(4)	(8)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	400	(3)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	400	(3)	(6)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	300	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,088	03/11/2023	300	(2)	(4)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,910	10/11/2023	900	(6)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,910	10/11/2023	900	(6)	(12)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	1 600	(6)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	1 600	(6)	(11)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	1 000	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/11/2023	1 000	(4)	(8)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	900	(3)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	900	(3)	(6)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,697	02/04/2024	2 000	(16)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,697	02/04/2024	2 000	(16)	(25)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,721	08/04/2024	600	(5)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,721	08/04/2024	600	(5)	(7)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	05/04/2023	3 900	(7)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	05/04/2023	3 900	(7)	(60)	(0,02)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	11/04/2023	6 800	(13)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	11/04/2023	6 800	(13)	(106)	(0,03)

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700 %	24/04/2023	1 300	$ (1)	$ 0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	24/04/2023	1 300	(4)	(18)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	26/04/2023	1 300	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	26/04/2023	1 300	(2)	(18)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	15/05/2023	1 800	(3)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	15/05/2023	1 800	(3)	(29)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	1 100	(13)	(3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	1 100	(15)	(36)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,230	23/01/2023	900	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,730	23/01/2023	900	(2)	(5)	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À recevoir	0,820	16/12/2024	4 600	(33)	(7)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	12/01/2023	600	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	12/01/2023	600	(2)	(2)	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,993	11/10/2023	400	(3)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,993	11/10/2023	400	(3)	(5)	0,00
							$ (452)	$ (1 125)	(0,27)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000) %	20/06/2023	$ 2 100	$ (52)	$ 44	$ (8)	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement chinois	(1,000)	20/06/2023	1 200	(23)	18	(5)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/06/2023	1 500	(39)	34	(5)	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement chinois	(1,000)	20/06/2023	2 200	(42)	34	(8)	(0,01)
HUS	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/06/2023	1 200	(30)	26	(4)	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/06/2023	1 700	(41)	35	(6)	0,00
					$ (227)	$ 191	$ (36)	(0,01)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[2]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000 %	20/06/2025	$ 500	$ (12)	$ 14	$ 2	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	400	(10)	12	2	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	500	(12)	15	3	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement d'Abou Dabi	1,000	20/12/2026	1 100	32	(6)	26	0,01
					$ (2)	$ 35	$ 33	0,01

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

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

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

SWAPS SUR DEVISES CROISÉES

Contrepartie	À recevoir	À payer	Date d'échéance	Montant notionnel de la devise reçue	Montant notionnel de la devise livrée	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
AZD	Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,290 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	04/01/2031	AUD 700	$ 527	$ 3	$ (2)	$ 1	0,00
CBK	Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,420 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	31/07/2029	5 900	4 071	(1)	8	7	0,00
GLM	Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,423 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	01/08/2029	5 600	3 864	(11)	8	(3)	0,00
						$ (9)	$ 14	$ 5	0,00

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500 %	21/09/2027	MYR 8 300	$ 3	$ 18	$ 21	0,01
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000	21/09/2024	THB 89 900	(4)	(1)	(5)	0,00
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	21/12/2027	67 500	(10)	7	(3)	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	15/06/2032	17 700	(2)	(21)	(23)	(0,01)
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,750	15/06/2032	8 430	(3)	8	5	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,750	21/09/2032	24 600	(1)	20	19	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	3,250	15/06/2032	100	0	0	0	0,00
BPS	À payer	THBFIX THB à 6 mois	3,250	15/06/2032	3 400	1	5	6	0,00
CBK	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	16/03/2032	MYR 8 100	9	64	73	0,02
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,480	18/05/2027	THB 4 000	0	1	1	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,810	18/05/2037	32 000	0	(35)	(35)	(0,01)
GLM	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	21/09/2027	MYR 4 500	1	10	11	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	21/09/2032	4 400	(3)	24	21	0,01
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	15/06/2032	THB 13 800	(1)	(17)	(18)	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	3,250	15/06/2032	800	0	1	1	0,00
GST	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000	21/09/2024	275 000	(29)	15	(14)	0,00
JPM	À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,960	11/02/2029	COP 15 800	0	1	1	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	15/06/2032	THB 24 400	(3)	(29)	(32)	(0,01)
SCX	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	21/09/2027	MYR 3 500	3	6	9	0,00
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000	21/09/2024	THB 380 319	17	(36)	(19)	(0,01)
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000	21/09/2027	2 828	0	1	1	0,00
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	21/09/2027	121 300	(22)	14	(8)	0,00
						$ (44)	$ 56	$ 12	0,00

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	02/2023	$ 421	AUD 629	$ 6	$ 0	$ 6	0,00
BOA	01/2023	HUF 45 147	$ 115	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	$ 123	BRL 641	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	491	HUF 222 264	100	0	100	0,02
	01/2023	80	RON 404	7	0	7	0,00
	01/2023	1	THB 48	0	0	0	0,00
	01/2023	58	ZAR 1 033	2	0	2	0,00
	02/2023	€ 2 080	$ 2 205	0	(22)	(22)	(0,01)
	02/2023	¥ 51 900	385	0	(10)	(10)	0,00
	02/2023	$ 6 104	CAD 8 103	0	(121)	(121)	(0,03)
	02/2023	3 851	CHF 3 647	109	0	109	0,03
	02/2023	2 817	€ 2 667	37	0	37	0,01
	02/2023	1 252	¥ 167 500	27	(2)	25	0,01
	02/2023	2 140	NOK 21 243	20	0	20	0,01
	02/2023	2 378	SEK 24 631	0	(8)	(8)	0,00
	02/2023	86	ZAR 1 540	4	0	4	0,00
	03/2023	MYR 2 740	$ 607	0	(22)	(22)	(0,01)
	03/2023	$ 205	INR 17 114	1	0	1	0,00
	03/2023	403	ZAR 7 109	13	0	13	0,00
	05/2023	CNH 8 080	$ 1 249	69	0	69	0,02
BPS	01/2023	HUF 175 855	449	0	(20)	(20)	0,00
	01/2023	TWD 22 286	728	1	0	1	0,00
	01/2023	$ 5	THB 178	0	0	0	0,00
	02/2023	€ 16 663	$ 17 278	0	(557)	(557)	(0,14)
	02/2023	ILS 2 588	784	49	0	49	0,01
	02/2023	$ 243	IDR 3 814 182	4	0	4	0,00
	03/2023	MXN 40 466	$ 2 006	0	(41)	(41)	(0,01)
	03/2023	MYR 56	12	0	(1)	(1)	0,00
	03/2023	TWD 4 135	137	2	0	2	0,00
	03/2023	$ 461	COP 2 258 511	0	(2)	(2)	0,00
	03/2023	11 328	INR 939 722	0	(28)	(28)	(0,01)
	03/2023	100	MYR 443	1	0	1	0,00
	03/2023	35	TWD 1 046	0	0	0	0,00
	05/2023	MYR 406	$ 87	0	(6)	(6)	0,00
BRC	01/2023	HUF 538 535	1 404	0	(31)	(31)	(0,01)
	01/2023	PEN 608	153	0	(6)	(6)	0,00
	01/2023	RON 617	124	0	(9)	(9)	0,00
	01/2023	$ 4 014	CNH 27 990	36	0	36	0,01
	01/2023	1 482	MYR 6 929	102	0	102	0,03
	01/2023	995	PHP 55 524	5	0	5	0,00
	01/2023	1 736	SGD 2 338	8	0	8	0,00
	01/2023	35	THB 1 223	0	0	0	0,00
	02/2023	TWD 45 346	$ 1 475	0	(7)	(7)	0,00
	02/2023	$ 1 998	CHF 1 874	37	0	37	0,01

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	03/2023	CNY	2 248	$	325	$ 0	$ (2)	$ (2)	0,00
	03/2023	INR	13 509		162	0	0	0	0,00
BSH	01/2023	$	120	BRL	650	3	0	3	0,00
CBK	01/2023	CLP	659 214	$	739	0	(33)	(33)	(0,01)
	01/2023	THB	21 529		623	0	0	0	0,00
	01/2023	$	5 667	BRL	29 742	0	(34)	(34)	(0,01)
	01/2023		347	CLP	307 011	13	0	13	0,00
	01/2023		248	DKK	1 725	0	0	0	0,00
	01/2023		123	KRW	157 537	2	0	2	0,00
	01/2023		1 571	NZD	2 458	0	(16)	(16)	0,00
	01/2023		218	THB	7 581	1	0	1	0,00
	02/2023	AUD	6 021	$	4 032	0	(58)	(58)	(0,01)
	02/2023	CLP	243 870		273	0	(12)	(12)	0,00
	02/2023	ILS	7 262		2 202	142	0	142	0,03
	02/2023	¥	50 000		362	0	(19)	(19)	0,00
	02/2023	$	377	BRL	2 032	6	0	6	0,00
	02/2023		470	CAD	639	2	0	2	0,00
	02/2023		256	€	240	1	0	1	0,00
	03/2023	PEN	33 120	$	8 239	0	(399)	(399)	(0,10)
	03/2023	$	95	MXN	1 867	0	(1)	(1)	0,00
	04/2023	CLP	65 452	$	74	0	(1)	(1)	0,00
	04/2023	ILS	6 456		1 967	128	0	128	0,03
	04/2023	$	485	CLP	422 582	3	0	3	0,00
	05/2023	CNH	886	$	137	8	0	8	0,00
	05/2023	ILS	7 735		2 354	146	0	146	0,04
	05/2023	MXN	214		11	0	0	0	0,00
	11/2023	ILS	5 907		1 765	56	0	56	0,01
CLY	01/2023	CNH	1 432		206	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	HUF	102 035		266	0	(6)	(6)	0,00
DUB	01/2023	DKK	33 412		4 709	0	(88)	(88)	(0,02)
	01/2023	TWD	8 990		294	0	0	0	0,00
GLM	01/2023	BRL	31 033		5 814	2	(65)	(63)	(0,02)
	01/2023	CLP	64 141		65	0	(10)	(10)	0,00
	01/2023	MYR	443		101	0	0	0	0,00
	01/2023	PEN	93		24	0	0	0	0,00
	01/2023	$	4 169	CNH	29 001	28	0	28	0,01
	01/2023		287	HKD	2 236	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		219	MYR	967	2	0	2	0,00
	01/2023		129	PEN	505	3	0	3	0,00
	01/2023		2 073	PLN	10 473	314	0	314	0,08
	01/2023		2 336	THB	81 436	18	0	18	0,00
	01/2023		88	ZAR	1 573	4	0	4	0,00
	02/2023		287	BRL	1 507	0	(3)	(3)	0,00
	02/2023		14	COP	64 906	0	(1)	(1)	0,00
	03/2023	CLP	405 956	$	446	0	(26)	(26)	(0,01)
	03/2023	CNH	9 735		1 507	92	0	92	0,02
	03/2023	COP	2 258 511		468	9	0	9	0,00
	03/2023	$	468	COP	2 258 511	0	(8)	(8)	0,00
	03/2023		353	KZT	171 575	9	0	9	0,00
	03/2023		654	MXN	13 451	26	0	26	0,01
	04/2023		4 601	BRL	24 957	45	0	45	0,01
	05/2023		1 294	PEN	5 148	42	0	42	0,01
	05/2023		38	ZAR	630	0	(1)	(1)	0,00
	06/2023		998	VND	25 691 912	72	0	72	0,02
IND	05/2023	CNH	12 852	$	1 987	110	0	110	0,03
JPM	01/2023	CAD	276		203	0	0	0	0,00
	01/2023	£	15 842		19 130	70	0	70	0,02
	01/2023	HUF	9		0	0	0	0	0,00
	01/2023	ILS	317		92	3	0	3	0,00
	01/2023	$	12 473	CNY	86 810	100	0	100	0,02
	01/2023		209	THB	7 248	1	0	1	0,00
	02/2023	TWD	703	$	23	0	0	0	0,00
	02/2023	$	418	IDR	6 587 939	8	0	8	0,00
	02/2023		16 162	¥	2 227 350	813	0	813	0,20
	03/2023		22 400	CNY	154 967	129	0	129	0,03
	03/2023		122	IDR	1 915 694	1	0	1	0,00
	04/2023	ILS	7 351	$	2 212	117	0	117	0,03
MBC	01/2023	DKK	30 314		4 282	0	(71)	(71)	(0,02)
	01/2023	£	433		528	7	0	7	0,00
	01/2023	$	617	CNH	4 292	4	0	4	0,00
	01/2023		415	£	339	0	(7)	(7)	0,00
	01/2023		1 192	HKD	9 281	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023		415	THB	14 373	1	0	1	0,00
	02/2023	€	1 348	$	1 396	0	(46)	(46)	(0,01)
	03/2023	COP	553 586		114	1	0	1	0,00
	03/2023	$	122	CLP	109 160	5	0	5	0,00
	03/2023		574	CNY	3 981	5	0	5	0,00
	03/2023		74	IDR	1 162 733	1	0	1	0,00
	05/2023		6 032	CNH	40 482	0	(125)	(125)	(0,03)
MYI	01/2023	€	2	$	2	0	0	0	0,00
	01/2023	MYR	881		200	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	PLN	549		110	0	(15)	(15)	0,00

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	01/2023	THB	250	$	7	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$	25	€	24	0	0	0	0,00
	01/2023		55	MYR	258	5	0	5	0,00
	01/2023		125	PEN	503	7	0	7	0,00
	02/2023	AUD	557	$	378	0	0	0	0,00
	02/2023	€	284		297	0	(7)	(7)	0,00
	02/2023	TWD	1 300		43	0	0	0	0,00
	02/2023	$	517	SEK	5 340	0	(3)	(3)	0,00
	02/2023		136	ZAR	2 481	10	0	10	0,00
	03/2023		104	IDR	1 638 262	1	0	1	0,00
	03/2023		164	INR	13 620	0	0	0	0,00
RBC	02/2023		3 246	NOK	32 390	48	0	48	0,01
	03/2023		5 250	MXN	105 002	70	0	70	0,02
RYL	01/2023		86	£	70	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023		71	HUF	26 781	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	NZD	5 359	$	3 338	0	(52)	(52)	(0,01)
	01/2023	PEN	1 119		278	0	(15)	(15)	0,00
	01/2023	TWD	59 547		1 893	0	(47)	(47)	(0,01)
	01/2023	$	415	CLP	412 784	69	0	69	0,02
	01/2023		206	CNH	1 431	1	0	1	0,00
	01/2023		3 112	KRW	4 111 804	157	0	157	0,04
	01/2023		199	MYR	881	2	0	2	0,00
	01/2023		175	THB	6 088	1	0	1	0,00
	02/2023		6 055	AUD	8 963	34	0	34	0,01
	02/2023		966	€	907	4	0	4	0,00
	02/2023		440	IDR	6 931 990	8	0	8	0,00
	02/2023		508	¥	68 000	10	0	10	0,00
	02/2023		2 786	TWD	85 718	17	0	17	0,00
	03/2023	INR	2 331	$	28	0	0	0	0,00
	03/2023	MYR	13 768		2 948	0	(213)	(213)	(0,05)
	03/2023	$	1 406	CNH	9 735	9	0	9	0,00
	05/2023	CNH	31 552	$	4 565	0	(40)	(40)	(0,01)
	05/2023	$	3 157	CNH	21 817	29	0	29	0,01
SOG	01/2023		806	RON	4 094	77	0	77	0,02
TOR	01/2023		129	PEN	516	6	0	6	0,00
UAG	01/2023	HUF	314 638	$	801	0	(38)	(38)	(0,01)
	01/2023	$	900	CZK	22 880	111	0	111	0,03
	02/2023	TWD	467	$	15	0	0	0	0,00
	02/2023	$	648	IDR	10 288 146	17	0	17	0,00
	03/2023		74	ZAR	1 326	3	0	3	0,00
	05/2023	CNH	6 736	$	972	0	(11)	(11)	0,00
	09/2023	$	447	ZAR	7 833	4	0	4	0,00
						$ 3 893	$ (2 383)	$ 1 510	0,37

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (partiellement couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	38 361	CHF	36 287	$ 885	$ 0	$ 885	0,22
BOM	01/2023	CAD	1 067	$	795	7	0	7	0,00
BRC	01/2023	NOK	5 368		539	0	(6)	(6)	0,00
	01/2023	SEK	8 409		803	0	(5)	(5)	0,00
CBK	01/2023		192		18	0	0	0	0,00
	01/2023	$	46 687	CHF	44 106	1 015	0	1 015	0,25
JPM	01/2023	£	3 540	$	4 274	16	0	16	0,00
MBC	01/2023	AUD	93		62	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	CAD	1 295		965	10	0	10	0,00
	01/2023	CHF	613		665	2	0	2	0,00
	01/2023	DKK	3 643		509	0	(14)	(14)	0,00
	01/2023	€	23 405		24 530	0	(460)	(460)	(0,11)
	01/2023	£	177		216	3	0	3	0,00
	01/2023	¥	209 608		1 526	0	(64)	(64)	(0,02)
	01/2023	NOK	573		59	0	0	0	0,00
	01/2023	$	191	€	179	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	AUD	2 936	$	1 972	0	(20)	(20)	(0,01)
	01/2023	¥	862 825		6 294	0	(250)	(250)	(0,06)
RBC	01/2023	AUD	34		23	0	0	0	0,00
SCX	01/2023		197		133	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	CAD	931		693	6	0	6	0,00
	01/2023	NZD	652		406	0	(6)	(6)	0,00
UAG	01/2023	SEK	536		51	0	0	0	0,00
						$ 1 944	$ (827)	$ 1 117	0,27

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (partiellement couverte) de capitalisation et E en EUR (partiellement couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	CHF	218	$	231	$ 0	$ (5)	$ (5)	0,00
	01/2023	£	144		174	1	0	1	0,00
	01/2023	¥	42 058		319	0	0	0	0,00
	01/2023	$	4	€	3	0	0	0	0,00
BOM	01/2023	CAD	1 946	$	1 449	13	0	13	0,00
BRC	01/2023	NOK	9 824		987	0	(10)	(10)	0,00
	01/2023	SEK	15 646		1 494	0	(8)	(8)	0,00
CBK	01/2023	CHF	1 812		1 919	0	(41)	(41)	(0,01)
	01/2023	€	28		30	0	0	0	0,00
	01/2023	SEK	358		34	0	0	0	0,00
	01/2023	$	241	€	228	2	0	2	0,00
JPM	01/2023	£	6 440	$	7 777	28	0	28	0,01
MBC	01/2023	AUD	552		374	1	(1)	0	0,00
	01/2023	CAD	2 360		1 759	17	0	17	0,01
	01/2023	DKK	6 779		948	0	(25)	(25)	(0,01)
	01/2023	€	31		32	0	0	0	0,00
	01/2023	£	282		343	4	0	4	0,00
	01/2023	¥	339 498		2 466	0	(109)	(109)	(0,03)
	01/2023	NOK	1 049		107	1	0	1	0,00
	01/2023	$	76 360	€	72 824	1 393	0	1 393	0,34
MYI	01/2023	AUD	4 996	$	3 355	0	(34)	(34)	(0,01)
	01/2023	¥	1 610 117		11 744	0	(466)	(466)	(0,11)
RBC	01/2023	AUD	58		39	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	CAD	501		369	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01/2023	AUD	335		226	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	CAD	1 697		1 263	11	0	11	0,00
	01/2023	NZD	817		509	0	(8)	(8)	0,00
	01/2023	$	38 724	€	37 205	999	0	999	0,24
UAG	01/2023	SEK	998	$	95	0	(1)	(1)	0,00
						$ 2 470	$ (712)	$ 1 758	0,43

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (partiellement couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	CHF	0	$	0	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$	11	¥	1 488	0	0	0	0,00
	01/2023		1	NOK	8	0	0	0	0,00
	01/2023		1	SEK	11	0	0	0	0,00
BOM	01/2023	CAD	1	$	1	0	0	0	0,00
BPS	01/2023	$	3	CAD	5	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	NOK	7	$	1	0	0	0	0,00
	01/2023	SEK	11		1	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	CHF	2		2	0	0	0	0,00
	01/2023	SEK	0		0	0	0	0	0,00
	01/2023	$	2	CHF	2	0	0	0	0,00
JPM	01/2023		35	€	32	0	0	0	0,00
	01/2023		55	£	46	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	AUD	0	$	0	0	0	0	0,00
	01/2023	CAD	2		1	0	0	0	0,00
	01/2023	DKK	5		1	0	0	0	0,00
	01/2023	€	32		34	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	¥	303		2	0	0	0	0,00
	01/2023	NOK	1		0	0	0	0	0,00
	01/2023	$	4	£	3	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	AUD	4	$	3	0	0	0	0,00
	01/2023	¥	1 185		9	0	0	0	0,00
	01/2023	$	1	DKK	5	0	0	0	0,00
RBC	01/2023	AUD	0	$	0	0	0	0	0,00
SCX	01/2023		0		0	0	0	0	0,00
	01/2023	CAD	1		1	0	0	0	0,00
	01/2023	£	94		115	2	0	2	0,00
	01/2023	NZD	1		1	0	0	0	0,00
	01/2023	$	3	AUD	5	0	0	0	0,00
TOR	01/2023		55	£	46	0	0	0	0,00
	01/2023		1	NZD	1	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	SEK	1	$	0	0	0	0	0,00
						$ 2	$ (1)	$ 1	0,00

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (partiellement couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	CHF	55	$	58	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
BOM	01/2023	CAD	542		404	4	0	4	0,00
BRC	01/2023	SEK	3 888		371	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$	17 474	NOK	173 874	181	0	181	0,04
CBK	01/2023	CHF	457	$	483	0	(11)	(11)	0,00
	01/2023	SEK	89		9	0	0	0	0,00
	01/2023	$	18 878	NOK	187 121	122	0	122	0,03
JPM	01/2023	£	1 740	$	2 101	8	0	8	0,00
MBC	01/2023	AUD	44		29	0	0	0	0,00
	01/2023	CAD	657		490	5	0	5	0,00
	01/2023	DKK	1 799		252	0	(7)	(7)	0,00
	01/2023	€	11 530		12 085	0	(225)	(225)	(0,06)
	01/2023	£	78		95	1	0	1	0,00
	01/2023	¥	91 438		664	0	(29)	(29)	(0,01)
	01/2023	$	1 296	NOK	12 682	0	(9)	(9)	0,00
MYI	01/2023	AUD	1 389	$	933	0	(9)	(9)	0,00
	01/2023	¥	433 656		3 163	0	(126)	(126)	(0,03)
RBC	01/2023	AUD	16		11	0	0	0	0,00
RYL	01/2023	$	7	NOK	70	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	AUD	93	$	63	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	CAD	473		352	3	0	3	0,00
	01/2023	NZD	253		158	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	$	4 620	NOK	45 843	35	0	35	0,01
UAG	01/2023	SEK	248	$	24	0	0	0	0,00
						$ 359	$ (423)	$ (64)	(0,02)
Total des Instruments financiers dérivés hors cote								**$ 3 739**	**0,91**

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
2,000 % éch. 01/01/2038	$ 7 000	$ (6 227)	(1,52)
2,000 % éch. 01/01/2053	27 750	(22 586)	(5,51)
Total des Titres vendus à découvert		**$ (28 813)**	**(7,03)**
Total des Investissements		**$ 439 080**	**106,97**
Autres actifs et passifs à court terme		**$ (28 621)**	**(6,97)**
Actif net		**$ 410 459**	**100,00**

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

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

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(e) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

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

(g) Affilié au Fonds.

(h) Titre convertible conditionnel.

(i) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,20 %) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Citigroup, Inc.	3,785 %	17/03/2033	10/03/2022	$ 1 300	$ 1 115	0,27
Deutsche Bank AG	3,035	28/05/2032	21/06/2021	1 063	798	0,19
				$ 2 363	$ 1 913	0,46

(j) Un titre d'une juste valeur globale de 1 525 $ (31 décembre 2021 : 35 097 $) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 13 884 $ (31 décembre 2021 : 7 202 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 1 120 $ (31 décembre 2021 : 2 490 $ a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

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

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 442 801	$ 831	$ 443 632
Fonds d'investissement	18 242	0	0	18 242
Contrats de mise en pension	0	1 408	0	1 408
Instruments financiers dérivés[3]	4 652	(41)	0	4 611
Titres vendus à découvert	0	(28 813)	0	(28 813)
Totaux	**$ 22 894**	**$ 415 355**	**$ 831**	**$ 439 080**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 587 365	$ 0	$ 587 365
Fonds d'investissement	18 823	0	0	18 823
Contrats de mise en pension	0	206	0	206
Instruments financiers dérivés[3]	1 409	(154)	0	1 255
Titres vendus à découvert	0	(57 191)	0	(57 191)
Totaux	**$ 20 232**	**$ 530 226**	**$ 0**	**$ 550 458**

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

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

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

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	En % de l'actif net
MEI	0,500 %	24/11/2022	TBD[1]	€ (1 409)	$ (1 504)	(0,37)
Total des Contrats de prise en pension					**$ (1 504)**	**(0,37)**

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

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

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ 7	$ 0	$ 7	$ (2)	$ 0	$ (2)
BOA	1 000	(730)	270	(436)	580	144
BOM	24	0	24	S/O	S/O	S/O
BPS	(629)	560	(69)	(1 083)	840	(243)
BRC	272	0	272	(31)	230	199
BSH	3	0	3	S/O	S/O	S/O
CBK	1 063	(1 120)	(57)	23	0	23
CLY	(8)	0	(8)	S/O	S/O	S/O
DUB	(125)	20	(105)	64	0	64
FBF	S/O	S/O	S/O	8	0	8
GLM	150	(370)	(220)	(90)	310	220
GSC	S/O	S/O	S/O	(1)	0	(1)
GST	4	0	4	(11)	0	(11)
HUS	(4)	0	(4)	(190)	260	70
IND	110	0	110	S/O	S/O	S/O
JPM	1 248	(760)	488	88	0	88
MBC	264	(90)	174	S/O	S/O	S/O
MYC	(5)	0	(5)	(36)	(560)	(596)
MYI	(909)	540	(369)	1 066	(1 080)	(14)
NAB	S/O	S/O	S/O	274	(270)	4
RBC	116	0	116	9	(10)	(1)
RYL	(2)	0	(2)	(293)	270	(23)
SCX	992	(910)	82	1 310	(1 270)	40
SOG	77	(70)	7	2	0	2
TOR	6	0	6	385	(400)	(15)
UAG	85	0	85	556	(280)	276
WST	S/O	S/O	S/O	(1)	0	(1)

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

Tableau des investissements Fonds Global Advantage Fund (suite)

Informations comparatives

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

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	65,89	86,42
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	41,33	25,84
Autres valeurs mobilières	0,88	0,47
Fonds d'investissement	4,44	3,61
Contrats de mise en pension	0,34	0,04
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	1,08	0,29
Instruments financiers dérivés compensés	(0,87)	(0,36)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,91	0,31
Titres vendus à découvert	(7,03)	(10,98)
Contrats de prise en pension	(0,37)	(6,80)

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

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Argentine	0,02	0,03
Australie	1,74	3,10
Brésil	0,76	1,12
Canada	0,73	0,79
Îles Caïmans	5,78	2,41
Chili	0,56	0,46
Chine	S/O	5,11
Colombie	0,02	0,02
République tchèque	0,10	0,09
Danemark	2,67	3,92
République dominicaine	0,16	0,16
France	2,83	2,73
Allemagne	2,33	2,82
Guatemala	0,10	0,09
Hong Kong	0,21	0,27
Hongrie	0,03	0,09
Inde	S/O	0,35
Indonésie	1,10	1,02
Irlande	5,34	4,54
Israël	0,98	1,15
Italie	7,32	6,69
Côte d'Ivoire	0,35	S/O
Japon	4,40	9,32
Koweït	S/O	0,82
Luxembourg	0,67	1,01
Malaisie	0,98	1,14
Mexique	0,28	0,31
Maroc	0,37	S/O
Multinationales	0,25	0,25
Pays-Bas	1,59	1,58
Nouvelle-Zélande	0,07	0,07
Norvège	0,20	0,13
Pérou	1,68	1,80
Philippines	0,08	0,09
Pologne	0,03	S/O
Portugal	0,09	0,10
Qatar	0,08	0,50
Roumanie	0,63	0,81
Russie	0,20	0,90
Arabie saoudite	S/O	0,86
Serbie	0,88	0,91
Singapour	0,20	1,56
Slovénie	0,18	0,31
Afrique du Sud	0,09	0,25
Corée du Sud	0,78	0,78
Espagne	1,04	1,42
Supranationales	0,71	0,67
Suisse	1,64	1,23
Thaïlande	0,26	S/O
Émirats arabes unis	0,05	0,41
Royaume-Uni	9,05	12,51
États-Unis	45,54	35,04
Instruments à court terme	2,95	0,99
Fonds d'investissement	4,44	3,61
Contrats de mise en pension	0,34	0,04
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	1,09	0,29
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,01)	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	S/O	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection	(0,15)	(0,01)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	S/O	0,00
Swaps de taux d'intérêt - Swaps de base	0,01	0,01
Swaps de taux d'intérêt	(0,73)	(0,36)

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,05	0,01
Options sur titres	0,08	0,02
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Options de change	S/O	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,27)	(0,15)
Options à taux d'intérêt plafonnées	S/O	0,00
Options sur titres	S/O	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	(0,01)	(0,03)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,01	0,00
Swaps sur devises croisées	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	0,00	0,04
Contrats de change à terme	0,37	(0,14)
Contrats de change à terme couverts	0,68	0,56
Titres vendus à découvert	(7,03)	(10,98)
Autres actifs et passifs à court terme	(6,97)	(5,64)
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
AUSTRALIE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Pepper SPARKZ Trust				
4,062 % éch. 17/08/2028	AUD	5 573	$ 3 769	0,03
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Interstar Millennium Trust				
3,435 % éch. 27/03/2038		8	5	0,00
Pepper Residential Securities Trust				
4,210 % éch. 16/09/2059		4 829	3 259	0,03
RESIMAC Bastille Trust				
5,102 % éch. 05/09/2057	$	1 954	1 953	0,02
			5 217	0,05
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement australien				
0,500 % éch. 21/09/2026	AUD	146 900	89 008	0,78
1,000 % éch. 21/12/2030		14 400	7 797	0,07
1,250 % éch. 21/05/2032		13 600	7 233	0,06
1,750 % éch. 21/06/2051		16 900	6 642	0,06
2,500 % éch. 21/05/2030		17 800	10 981	0,09
4,500 % éch. 21/04/2033		63 300	44 541	0,39
			166 202	1,45
Total Australie			175 188	1,53
AUTRICHE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Erste Group Bank AG				
4,250 % éch. 15/10/2027 (f)(h)	€	9 800	8 319	0,07
BRÉSIL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Bradesco S.A.				
2,850 % éch. 27/01/2023	$	300	300	0,00
CANADA				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Bank of Montreal				
0,200 % éch. 26/01/2023	€	500	533	0,01
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
2,750 % éch. 29/03/2028		15 200	14 197	0,12
			14 730	0,13
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Real Estate Asset Liquidity Trust				
3,072 % éch. 12/08/2053	CAD	1 805	1 321	0,01
3,650 % éch. 12/08/2053		7 100	4 998	0,04
			6 319	0,05
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement canadien				
2,000 % éch. 01/06/2028		650	450	0,00
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien				
1,500 % éch. 01/12/2044 (e)		10 375	7 973	0,07
CPPIB Capital, Inc.				
0,750 % éch. 02/02/2037 (j)	€	2 200	1 610	0,02
Ontario Teachers' Finance Trust				
0,900 % éch. 20/05/2041		9 700	6 680	0,06
Province de l'Alberta				
3,350 % éch. 01/11/2023	$	3 800	3 759	0,03
Province de l'Ontario				
0,010 % éch. 25/11/2030	€	30 200	24 681	0,22
Province du Québec				
3,000 % éch. 01/09/2023	CAD	16 200	11 832	0,10
			56 985	0,50
Total Canada			78 034	0,68
ÎLES CAÏMANS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Apidos CLO				
5,159 % éch. 15/04/2031	$	4 500	4 435	0,04
5,413 % éch. 20/10/2031		12 240	11 992	0,11
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				
5,229 % éch. 16/01/2030	$	11 047	$ 10 930	0,10
Benefit Street Partners CLO Ltd.				
5,333 % éch. 20/04/2031		8 370	8 263	0,07
BlueMountain CLO Ltd.				
5,159 % éch. 15/07/2031		8 250	8 114	0,07
Carbone CLO Ltd.				
5,383 % éch. 20/01/2031		6 990	6 895	0,06
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.				
5,179 % éch. 15/10/2030		2 882	2 854	0,02
5,656 % éch. 15/05/2031		5 938	5 857	0,05
Catamaran CLO Ltd.				
5,425 % éch. 22/04/2030		25 768	25 400	0,22
CBAM CLO Ltd.				
5,363 % éch. 20/10/2029		27 151	26 825	0,23
5,493 % éch. 20/07/2030		18 539	18 355	0,16
Deer Creek CLO Ltd.				
5,423 % éch. 20/10/2030		5 500	5 444	0,05
Dryden Senior Loan Fund				
5,049 % éch. 15/04/2031		10 400	10 233	0,09
Gallatin CLO Ltd.				
5,328 % éch. 21/01/2028		7 176	7 118	0,06
ICG U.S. CLO Ltd.				
5,405 % éch. 22/07/2031		13 700	13 408	0,12
Marble Point CLO Ltd.				
5,374 % éch. 18/12/2030		15 100	14 812	0,13
Midocean Credit CLO				
5,347 % éch. 19/07/2028		9 875	9 829	0,09
OZLM Ltd.				
5,393 % éch. 20/01/2031		3 900	3 836	0,03
5,674 % éch. 16/05/2030		8 903	8 768	0,08
Palmer Square CLO Ltd.				
5,209 % éch. 17/01/2031		3 800	3 765	0,03
Regatta Funding Ltd.				
5,329 % éch. 17/10/2030		8 700	8 605	0,08
Sound Point CLO Ltd.				
5,427 % éch. 26/07/2031		1 200	1 168	0,01
Venture CLO Ltd.				
4,959 % éch. 15/04/2027		2 050	2 047	0,02
			218 953	1,92
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % éch. 18/11/2027		431	345	0,00
Country Garden Holdings Co. Ltd.				
2,700 % éch. 12/07/2026		1 400	802	0,01
KSA Sukuk Ltd.				
5,268 % éch. 25/10/2028		11 700	12 176	0,11
QNB Finance Ltd.				
1,375 % éch. 26/01/2026		2 060	1 847	0,01
S.A. Global Sukuk Ltd.				
2,694 % éch. 17/06/2031		4 400	3 769	0,03
Sands China Ltd.				
5,625 % éch. 08/08/2025		4 100	3 925	0,03
5,900 % éch. 08/08/2028		9 300	8 720	0,08
Tencent Holdings Ltd.				
3,595 % éch. 19/01/2028		13 540	12 434	0,11
3,925 % éch. 19/01/2038		1 100	878	0,01
			44 896	0,39
Total îles Caïmans			263 849	2,31
CHINE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Sinopec Group Overseas Development Ltd.				
2,300 % éch. 08/01/2031		750	631	0,01
RÉPUBLIQUE TCHÈQUE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de République tchèque				
2,500 % éch. 25/08/2028	CZK	2 900	112	0,00
DANEMARK				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Jyske Realkredit A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	508 210	$ 51 544	0,45
1,500 % éch. 01/10/2037		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
1,000 % éch. 01/10/2050		624 300	63 107	0,55
1,500 % éch. 01/10/2037		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		40 991	4 540	0,04
2,000 % éch. 01/10/2037		0	0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/10/2037		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050		1 274 732	132 270	1,16
1,000 % éch. 01/10/2053		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2037		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		8 276	916	0,01
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/10/2036		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
3,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050		119 791	12 682	0,11
1,000 % éch. 01/10/2053		35 648	3 734	0,03
1,500 % éch. 01/10/2053		8 675	960	0,01
2,000 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/04/2036		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/04/2047		0	0	0,00
3,000 % éch. 01/07/2046		0	0	0,00
3,797 % éch. 01/01/2038		0	0	0,00
Total Danemark			269 753	2,36
FINLANDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nordea Kiinnitysluottopankki Oyj				
0,625 % éch. 23/05/2025	€	1 000	1 002	0,01
FRANCE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BNP Paribas S.A.				
1,675 % éch. 30/06/2027	$	16 200	14 118	0,12
2,219 % éch. 09/06/2026		5 200	4 779	0,04
2,591 % éch. 20/01/2028		19 553	17 224	0,15
2,871 % éch. 19/04/2032		14 000	10 980	0,10
4,400 % éch. 14/08/2028		200	189	0,00
Dexia Credit Local S.A.				
0,000 % éch. 21/01/2028 (c)	€	9 100	8 252	0,07
0,500 % éch. 17/01/2025		2 300	2 320	0,02
0,750 % éch. 25/01/2023		24 200	25 811	0,23
3,250 % éch. 26/09/2023	$	6 100	6 029	0,05
Mutuelle Assurance Des Commerçants et Industriels de France et Des Cadres et Sal				
0,625 % éch. 21/06/2027	€	7 000	6 175	0,05
Société Générale S.A.				
1,488 % éch. 14/12/2026	$	21 700	18 883	0,17
2,226 % éch. 21/01/2026		24 200	22 275	0,20
2,797 % éch. 19/01/2028		17 500	15 335	0,13
6,221 % éch. 15/06/2033		20 600	19 323	0,17
			171 693	1,50
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Bpifrance Financement S.A.				
3,000 % éch. 10/09/2026	€	12 500	13 233	0,11
Obligation internationale du gouvernement français				
0,500 % éch. 25/06/2044		6 750	4 163	0,04
0,500 % éch. 25/05/2072		15 250	6 069	0,05
0,750 % éch. 25/05/2052		115 450	65 069	0,57
2,000 % éch. 25/05/2048		73 081	60 293	0,53

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
3,250 % éch. 25/05/2045	€	19 100	$ 20 110	0,18
			168 937	1,48
Total France			340 630	2,98
ALLEMAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Aareal Bank AG				
0,625 % éch. 14/02/2025	$	800	731	0,01
Deutsche Bank AG				
0,050 % éch. 20/11/2024	€	19 600	19 637	0,17
0,750 % éch. 17/02/2027		4 600	4 287	0,04
1,000 % éch. 19/11/2025		3 800	3 790	0,03
1,375 % éch. 03/09/2026		32 100	31 256	0,27
1,375 % éch. 17/02/2032		14 300	11 140	0,10
1,625 % éch. 20/01/2027		54 400	51 279	0,45
1,750 % éch. 19/11/2030		20 500	17 231	0,15
1,875 % éch. 23/02/2028		5 900	5 517	0,05
2,625 % éch. 16/12/2024	£	23 600	26 398	0,23
3,547 % éch. 18/09/2031	$	12 700	10 209	0,09
3,729 % éch. 14/01/2032 (i)		2 000	1 470	0,01
3,961 % éch. 26/11/2025		26 750	25 580	0,22
4,100 % éch. 13/01/2026		1 800	1 732	0,02
6,119 % éch. 14/07/2026		19 300	19 189	0,17
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % en numéraire ou 4,500 % de rémunération en nature)				
3,750 % éch. 15/09/2026 (b)	€	12 050	11 217	0,10
IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % en numéraire ou 4,625 % de rémunération en nature)				
3,875 % éch. 15/05/2027 (b)		3 000	2 717	0,02
IHO Verwaltungs GmbH (6,000 % en numéraire ou 6,750 % de rémunération en nature)				
6,000 % éch. 15/05/2027 (b)	$	600	528	0,01
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				
5,000 % éch. 19/03/2024	AUD	1 500	1 030	0,01
Schaeffler AG				
3,375 % éch. 12/10/2028	€	100	93	0,00
Total Allemagne			245 031	2,15
HONG KONG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Huarong Finance Co. Ltd.				
2,125 % éch. 30/09/2023	$	14 200	13 667	0,12
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.				
3,150 % éch. 12/05/2025		8 300	7 595	0,07
6,307 % éch. 25/05/2023		6 900	6 857	0,06
Total Hong Kong			28 119	0,25
HONGRIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement hongrois				
3,000 % éch. 27/10/2027	HUF	117 500	227	0,00
5,000 % éch. 22/02/2027	€	4 100	4 348	0,04
7,625 % éch. 29/03/2041	$	100	110	0,00
Total Hongrie			4 685	0,04
IRLANDE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Accunia European CLO DAC				
2,328 % éch. 15/07/2030	€	6 287	6 577	0,06
Adagio CLO DAC				
2,098 % éch. 15/10/2031		10 250	10 663	0,09
Aqueduct European CLO DAC				
2,096 % éch. 20/07/2030		13 460	14 083	0,12
Ares European CLO				
2,038 % éch. 15/10/2030		8 174	8 515	0,08
Ares European CLO DAC				
1,988 % éch. 15/04/2030		7 017	7 287	0,06
2,038 % éch. 15/10/2030		7 477	7 788	0,07
2,158 % éch. 15/10/2031		24 100	24 931	0,22
2,306 % éch. 20/04/2032		9 100	9 433	0,08
Armada Euro CLO DAC				
2,098 % éch. 15/07/2031		9 000	9 331	0,08
Aurium CLO DAC				
2,108 % éch. 16/01/2031		28 788	30 049	0,26
Avoca CLO DAC				
2,198 % éch. 15/10/2032	€	9 800	$ 10 126	0,09
Bain Capital Euro CLO DAC				
2,196 % éch. 20/01/2032		12 500	12 998	0,11
Black Diamond CLO DAC				
2,778 % éch. 15/05/2032		5 400	5 588	0,05
2,834 % éch. 03/10/2029		86	91	0,00
4,793 % éch. 03/10/2029	$	112	112	0,00
Blackrock European CLO DAC				
1,998 % éch. 15/10/2031	€	10 800	11 176	0,10
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				
2,098 % éch. 15/01/2031		11 245	11 674	0,10
BNPP AM Euro CLO DAC				
2,322 % éch. 22/07/2032		12 700	13 134	0,12
Cairn CLO BV				
2,158 % éch. 15/10/2031		16 400	17 134	0,15
Carlyle Euro CLO DAC				
2,428 % éch. 15/08/2030		7 025	7 318	0,06
2,688 % éch. 15/08/2032		3 200	3 318	0,03
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
2,548 % éch. 15/11/2031		11 500	11 894	0,10
Contego CLO DAC				
2,142 % éch. 23/01/2030		6 289	6 541	0,06
CVC Cordatus Loan Fund DAC				
2,112 % éch. 21/07/2030		21 295	22 279	0,20
Dryden Euro CLO DAC				
2,038 % éch. 15/04/2033		6 600	6 834	0,06
2,622 % éch. 15/05/2034		23 450	24 323	0,21
Griffith Park CLO DAC				
2,522 % éch. 21/11/2031		14 300	14 774	0,13
Harvest CLO DAC				
2,136 % éch. 20/10/2031		15 500	16 066	0,14
2,138 % éch. 15/07/2031		9 850	10 152	0,09
2,228 % éch. 15/01/2032		22 300	23 060	0,20
2,775 % éch. 26/06/2030		9 602	10 021	0,09
Jubilee CLO DAC				
1,978 % éch. 15/04/2030		20 800	21 721	0,19
2,028 % éch. 15/04/2031		1 100	1 141	0,01
2,128 % éch. 12/07/2028		178	189	0,00
2,846 % éch. 15/12/2029		2 678	2 805	0,03
Laurelin DAC				
2,176 % éch. 20/10/2031		15 000	15 520	0,14
Madison Park Euro Funding DAC				
2,128 % éch. 15/01/2032		22 900	23 663	0,21
2,178 % éch. 15/07/2032		7 300	7 549	0,07
Man GLG Euro CLO DAC				
2,188 % éch. 15/10/2032		10 294	10 629	0,09
Oak Hill European Credit Partners DAC				
2,196 % éch. 20/10/2031		24 100	24 956	0,22
OCP Euro CLO DAC				
2,382 % éch. 22/09/2034		22 300	23 132	0,20
Palmer Square European Loan Funding DAC				
2,098 % éch. 15/10/2031		12 419	12 853	0,11
2,108 % éch. 15/07/2031		3 645	3 787	0,03
2,158 % éch. 15/04/2031		16 814	17 448	0,15
Sculptor European CLO DAC				
2,153 % éch. 14/01/2032		35 800	37 183	0,33
Segovia European CLO DAC				
2,336 % éch. 20/07/2032		13 700	14 157	0,12
Tikehau CLO DAC				
2,596 % éch. 04/08/2034		10 600	10 983	0,10
Toro European CLO DAC				
2,239 % éch. 12/01/2032		9 300	9 562	0,08
2,572 % éch. 15/02/2034		22 750	23 418	0,21
			627 966	5,50
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AerCap Ireland Capital DAC				
1,650 % éch. 29/10/2024	$	5 450	5 031	0,05
1,750 % éch. 29/10/2024		5 300	4 877	0,04
2,450 % éch. 29/10/2026		200	175	0,00
3,000 % éch. 29/10/2028		900	756	0,01
3,500 % éch. 15/01/2025		1 300	1 239	0,01
5,003 % éch. 29/09/2023		7 250	7 118	0,06
			19 196	0,17
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Bruegel DAC				
2,621 % éch. 22/05/2031	€	343	$ 344	0,00
European Loan Conduit DAC				
2,803 % éch. 17/02/2030		3 129	3 195	0,03
			3 539	0,03
Total Irlande			650 701	5,70
ISRAËL				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement israélien				
1,000 % éch. 31/03/2030	ILS	800	189	0,00
1,500 % éch. 30/11/2023		102 800	28 591	0,25
2,000 % éch. 31/03/2027		87 900	23 280	0,20
4,125 % éch. 17/01/2048	$	900	791	0,01
Total Israël			52 851	0,46
ITALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AMCO - Asset Management Co. SpA				
0,750 % éch. 20/04/2028	€	300	257	0,00
1,500 % éch. 17/07/2023		35 500	37 529	0,33
Atlantia SpA				
1,875 % éch. 12/02/2028		8 700	7 741	0,07
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
0,875 % éch. 08/10/2027		8 000	7 590	0,07
2,000 % éch. 29/01/2024		26 600	27 890	0,24
2,625 % éch. 28/04/2025		2 800	2 712	0,02
Intesa Sanpaolo SpA				
5,875 % éch. 01/09/2031 (f)(h)		4 650	4 008	0,03
Nexi SpA				
1,625 % éch. 30/04/2026		6 639	6 476	0,06
UniCredit SpA				
2,200 % éch. 22/07/2027		4 450	4 310	0,04
7,500 % éch. 03/06/2026 (f)(h)		8 400	8 741	0,08
7,830 % éch. 04/12/2023	$	26 210	26 487	0,23
			133 741	1,17
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement italien				
6,000 % éch. 04/08/2028	£	5 684	6 906	0,06
Total Italie			140 647	1,23
JAPON				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
1,412 % éch. 17/07/2025	$	29 800	27 089	0,24
2,193 % éch. 25/02/2025		33 700	31 567	0,28
Mizuho Financial Group, Inc.				
1,241 % éch. 10/07/2024		9 000	8 784	0,08
3,922 % éch. 11/09/2024		11 000	10 826	0,09
5,387 % éch. 25/05/2024		13 100	13 030	0,11
5,735 % éch. 11/09/2024		13 000	12 967	0,11
Nissan Motor Co. Ltd.				
3,522 % éch. 17/09/2025		14 600	13 576	0,12
4,345 % éch. 17/09/2027		17 500	15 896	0,14
4,810 % éch. 17/09/2030		18 200	15 486	0,14
Nomura Holdings, Inc.				
2,329 % éch. 22/01/2027		11 100	9 732	0,09
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
0,010 % éch. 10/09/2025	€	43 700	42 320	0,37
0,409 % éch. 07/11/2029		26 500	22 834	0,20
0,550 % éch. 06/11/2023		35 700	37 207	0,33
2,440 % éch. 18/06/2024	$	26 400	25 384	0,22
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
5,087 % éch. 19/07/2023		31 100	31 121	0,27
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
0,010 % éch. 15/10/2027	€	34 800	31 299	0,27
			349 118	3,06
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Development Bank of Japan, Inc.				
1,750 % éch. 28/08/2024	$	13 400	12 687	0,11
1,875 % éch. 02/10/2024		12 800	12 166	0,11

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Japan Finance Organization for Municipalities				
0,625 % éch. 02/09/2025	$	1 400	$ 1 255	0,01
3,000 % éch. 12/03/2024		13 100	12 814	0,11
3,375 % éch. 27/09/2023		20 000	19 750	0,17
Obligation internationale du gouvernement japonais				
0,100 % éch. 10/03/2028 (e)	¥	10 531 194	82 569	0,72
0,200 % éch. 20/06/2036		362 750	2 506	0,02
0,500 % éch. 20/09/2046		8 768 000	54 166	0,47
0,500 % éch. 20/03/2049		11 468 000	68 068	0,60
0,700 % éch. 20/12/2048		8 081 650	50 767	0,45
0,700 % éch. 20/06/2051		202 000	1 230	0,01
1,000 % éch. 20/03/2052		70 000	460	0,00
1,300 % éch. 20/06/2052		500 000	3 565	0,03
Gouvernement de la métropole de Tokyo				
0,750 % éch. 16/07/2025	$	18 600	16 757	0,15
2,625 % éch. 29/05/2024		4 100	3 964	0,04
			342 724	3,00
Total Japon			691 842	6,06
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
G City Europe Ltd.				
4,250 % éch. 11/09/2025	€	10 000	8 964	0,08
LUXEMBOURG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Aroundtown S.A.				
0,000 % éch. 16/07/2026 (c)		11 000	8 378	0,07
0,375 % éch. 15/04/2027		1 700	1 203	0,01
5,375 % éch. 21/03/2029	$	2 700	2 047	0,02
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund				
0,900 % éch. 12/10/2029	€	200	156	0,00
CPI Property Group S.A.				
1,625 % éch. 23/04/2027		14 500	11 055	0,10
1,750 % éch. 14/01/2030		10 400	6 772	0,06
2,750 % éch. 12/05/2026		1 400	1 177	0,01
Logicor Financing SARL				
0,625 % éch. 17/11/2025		4 600	4 204	0,04
0,750 % éch. 15/07/2024		10 900	10 690	0,09
2,250 % éch. 13/05/2025		2 000	1 954	0,02
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
5,125 % éch. 29/10/2022 ^	$	500	58	0,00
			47 694	0,42
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Miravet SARL				
2,758 % éch. 26/05/2065	€	14 356	14 812	0,13
Total Luxembourg			62 506	0,55
MALAISIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Petronas Capital Ltd.				
2,480 % éch. 28/01/2032	$	5 500	4 560	0,04
3,500 % éch. 21/04/2030		8 600	7 865	0,07
4,550 % éch. 21/04/2050		6 100	5 470	0,05
4,800 % éch. 21/04/2060		5 000	4 604	0,04
			22 499	0,20
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement malaisien				
3,480 % éch. 15/03/2023	MYR	200 400	45 539	0,40
Total Malaisie			68 038	0,60
MEXIQUE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement mexicain				
4,000 % éch. 15/03/2115	€	800	602	0,01
5,000 % éch. 27/04/2051	$	7 800	6 358	0,05
10,000 % éch. 05/12/2024	MXN	130 573	6 715	0,06
Total Mexique			13 675	0,12

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
MULTINATIONALES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Preferred Term Securities Ltd.				
5,079 % éch. 22/12/2036	$	9 039	$ 8 407	0,07
5,169 % éch. 22/03/2038		3 264	3 042	0,03
Total Multinationales			11 449	0,10
PAYS-BAS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
ABN AMRO Bank NV				
1,125 % éch. 12/01/2032	€	300	267	0,00
Cooperatieve Rabobank UA				
3,758 % éch. 06/04/2033	$	2 300	1 966	0,02
CTP NV				
0,625 % éch. 27/09/2026	€	10 500	8 637	0,07
0,875 % éch. 20/01/2026		14 100	12 265	0,11
1,500 % éch. 27/09/2031		6 500	4 171	0,04
E.ON International Finance BV				
5,625 % éch. 06/12/2023	£	400	484	0,00
Enel Finance International NV				
0,000 % éch. 28/05/2026 (c)	€	5 300	4 997	0,04
1,875 % éch. 12/07/2028	$	2 500	1 990	0,02
2,250 % éch. 12/07/2031		400	292	0,00
2,650 % éch. 10/09/2024		25 800	24 702	0,22
IMCD NV				
2,500 % éch. 26/03/2025	€	200	207	0,00
ING Groep NV				
4,100 % éch. 02/10/2023	$	2 600	2 580	0,02
5,750 % éch. 16/11/2026 (f)(h)		800	711	0,01
5,754 % éch. 02/10/2023		2 400	2 406	0,02
LeasePlan Corp. NV				
1,000 % éch. 02/05/2023	€	300	318	0,00
Sagax Euro MTN NL BV				
1,625 % éch. 24/02/2026		11 900	11 181	0,10
Volkswagen Financial Services NV				
0,875 % éch. 20/02/2025	£	2 800	3 045	0,03
1,125 % éch. 18/09/2023		9 600	11 268	0,10
			91 487	0,80
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Domi BV				
2,896 % éch. 15/06/2051	€	136	144	0,00
Dutch Property Finance BV				
2,208 % éch. 28/04/2051		229	243	0,00
2,228 % éch. 28/07/2054		296	313	0,00
2,228 % éch. 28/07/2058		14 870	15 668	0,14
Eurosail BV				
2,878 % éch. 17/10/2040		59	63	0,00
Jubilee Place BV				
2,208 % éch. 17/07/2058		10 805	11 363	0,10
2,378 % éch. 17/10/2057		6 241	6 608	0,06
			34 402	0,30
Total Pays-Bas			125 889	1,10
NOUVELLE-ZÉLANDE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Auckland Council				
1,000 % éch. 19/01/2027		5 800	5 659	0,05
Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais				
1,500 % éch. 15/05/2031	NZD	22 600	11 382	0,10
2,000 % éch. 20/09/2025		1 930	780	0,01
5,500 % éch. 15/04/2023		9 063	5 745	0,05
Total Nouvelle-Zélande			23 566	0,21
NORVÈGE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
DNB Boligkreditt A/S				
3,250 % éch. 28/06/2023	$	4 600	4 558	0,04
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Kommunalbanken A/S				
0,625 % éch. 20/04/2026	€	600	588	0,01
1,900 % éch. 19/01/2027	AUD	22 000	13 503	0,12
5,250 % éch. 15/07/2024		3 300	2 274	0,02

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Obligation internationale du gouvernement norvégien				
1,250 % éch. 17/09/2031	NOK	1 900	$ 165	0,00
1,750 % éch. 13/03/2025		86 700	8 553	0,07
1,750 % éch. 17/02/2027		1 100	106	0,00
2,000 % éch. 26/04/2028		7 300	702	0,01
			25 891	0,23
Total Norvège			30 449	0,27
PÉROU				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement péruvien				
2,780 % éch. 01/12/2060	$	6 000	3 520	0,03
3,230 % éch. 28/07/2121		4 200	2 453	0,02
5,350 % éch. 12/08/2040	PEN	33 400	6 556	0,06
5,400 % éch. 12/08/2034		31 100	6 549	0,06
5,940 % éch. 12/02/2029		71 287	17 161	0,15
6,150 % éch. 12/08/2032		97 648	22 566	0,20
6,950 % éch. 12/08/2031		700	173	0,00
Total Pérou			58 978	0,52
POLOGNE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement polonais				
5,500 % éch. 16/11/2027	$	2 700	2 779	0,03
PORTUGAL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Espirito Santo S.A.				
4,000 % éch. 21/01/2019 ^	€	6 900	1 068	0,01
4,750 % éch. 15/01/2018 ^		1 900	294	0,00
Total Portugal			1 362	0,01
QATAR				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
QatarEnergy Trading LLC				
2,250 % éch. 12/07/2031	$	8 000	6 641	0,06
3,300 % éch. 12/07/2051		5 100	3 778	0,03
			10 419	0,09
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Qatar National Bank QPSC				
5,557 % éch. 06/11/2023		4 600	4 583	0,04
Total Qatar			15 002	0,13
ROUMANIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement roumain				
1,375 % éch. 02/12/2029	€	6 560	5 111	0,04
1,750 % éch. 13/07/2030		16 600	12 379	0,11
2,000 % éch. 28/01/2032		1 000	716	0,01
2,000 % éch. 14/04/2033		2 150	1 476	0,01
2,124 % éch. 16/07/2031		2 600	1 923	0,02
2,125 % éch. 07/03/2028		19 300	17 243	0,15
2,625 % éch. 02/12/2040		7 400	4 425	0,04
2,750 % éch. 14/04/2041		7 000	4 213	0,04
2,875 % éch. 13/04/2042		17 300	10 384	0,09
Total Roumanie			57 870	0,51
ARABIE SAOUDITE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Saudi Arabian Oil Co.				
2,250 % éch. 24/11/2030	$	12 600	10 411	0,09
3,250 % éch. 24/11/2050		6 500	4 596	0,04
3,500 % éch. 24/11/2070		1 600	1 093	0,01
Total Arabie saoudite			16 100	0,14
SERBIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement serbe				
1,000 % éch. 23/09/2028	€	16 750	12 893	0,11
1,650 % éch. 03/03/2033		12 300	8 008	0,07
2,050 % éch. 23/09/2036		6 700	4 054	0,04
Total Serbie			24 955	0,22

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
SLOVÉNIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % éch. 27/01/2025	€	11 200	$ 10 843	0,09
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % éch. 05/02/2030		3 500	3 100	0,03
3,650 % éch. 19/11/2029		8 300	7 441	0,07
Total Slovénie			21 384	0,19
AFRIQUE DU SUD				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement sud-africain				
7,750 % éch. 28/02/2023	ZAR	4 275	251	0,00
8,750 % éch. 28/02/2048		2 125	98	0,00
Total Afrique du Sud			349	0,00
CORÉE DU SUD				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen				
2,125 % éch. 10/06/2027	KRW	16 365 000	12 071	0,11
2,375 % éch. 10/12/2027		14 900 000	11 038	0,10
2,375 % éch. 10/12/2028		69 980 000	51 329	0,45
2,625 % éch. 10/06/2028		32 730 000	24 438	0,21
5,500 % éch. 10/03/2028		14 900 000	12 728	0,11
Total Corée du Sud			111 604	0,98
ESPAGNE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
BBVA Consumer Auto				
0,270 % éch. 20/07/2031	€	8 115	8 469	0,08
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
5,875 % éch. 24/09/2023 (f)(h)		10 400	10 694	0,09
Banco Santander S.A.				
1,849 % éch. 25/03/2026	$	5 800	5 126	0,05
4,175 % éch. 24/03/2028		7 800	7 246	0,06
4,375 % éch. 14/01/2026 (f)(h)	€	1 400	1 274	0,01
CaixaBank S.A.				
1,750 % éch. 24/10/2023		10 400	10 977	0,10
5,875 % éch. 09/10/2027 (f)(h)		2 800	2 745	0,02
			38 062	0,33
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Fondo de Titulizacion de Activos Santander Hipotecario				
1,553 % éch. 18/01/2049		463	484	0,00
Fondo de Titulizacion de Activos UCI				
2,186 % éch. 15/09/2041		866	884	0,01
IM Pastor Fondo de Titluzacion Hipotecaria				
2,261 % éch. 22/09/2041		0	0	0,00
			1 368	0,01
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Communauté autonome de Catalogne				
4,220 % éch. 26/04/2035		3 900	4 044	0,03
Communauté autonome de Madrid				
1,571 % éch. 30/04/2029		1 300	1 239	0,01
Obligation internationale du gouvernement espagnol				
1,450 % éch. 31/10/2071		7 375	3 611	0,03
1,900 % éch. 31/10/2052		2 700	1 836	0,02
3,450 % éch. 30/07/2066		53 300	50 311	0,44
5,250 % éch. 06/04/2029	£	800	990	0,01
			62 031	0,54
Total Espagne			109 930	0,96
SUPRANATIONALES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banque européenne pour la reconstruction et le développement				
0,500 % éch. 01/09/2023	AUD	5 400	3 579	0,03
0,500 % éch. 21/12/2023		4 000	2 617	0,02
Banque européenne d'investissement				
0,500 % éch. 10/08/2023	AUD	10 200	$ 6 779	0,06
4,600 % éch. 30/01/2037	CAD	1 050	795	0,01
Banque interaméricaine de développement				
2,500 % éch. 14/04/2027	AUD	15 200	9 545	0,08
Total Supranationales			23 315	0,20
SUÈDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Molnlycke Holding AB				
1,875 % éch. 28/02/2025	€	400	407	0,00
SUISSE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Credit Suisse AG				
0,250 % éch. 05/01/2026		11 800	10 718	0,10
6,500 % éch. 08/08/2023 (h)	$	30 906	30 001	0,26
Credit Suisse Group AG				
2,193 % éch. 05/06/2026		400	342	0,00
2,875 % éch. 02/04/2032	€	19 700	15 255	0,13
3,091 % éch. 14/05/2032	$	16 700	11 572	0,10
3,800 % éch. 09/06/2023		4 750	4 626	0,04
3,869 % éch. 12/01/2029		12 550	10 078	0,09
4,194 % éch. 01/04/2031		1 600	1 245	0,01
4,550 % éch. 17/04/2026		400	353	0,00
6,442 % éch. 11/08/2028		20 600	18 791	0,17
6,537 % éch. 12/08/2033		5 700	5 015	0,04
7,250 % éch. 12/09/2025 (f)(h)		1 200	863	0,01
7,375 % éch. 07/09/2033	£	14 900	16 365	0,14
7,750 % éch. 01/03/2029	€	7 900	8 400	0,07
UBS AG				
5,125 % éch. 15/05/2024 (h)	$	1 700	1 682	0,02
UBS Group AG				
4,488 % éch. 12/05/2026		1 500	1 467	0,01
4,703 % éch. 05/08/2027		4 100	3 968	0,04
4,751 % éch. 12/05/2028		2 600	2 492	0,02
Total Suisse			143 233	1,25
THAÏLANDE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais				
3,390 % éch. 17/06/2037	THB	333 598	10 034	0,09
3,450 % éch. 17/06/2043		793 970	23 273	0,20
Total Thaïlande			33 307	0,29
ÉMIRATS ARABES UNIS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
MDGH GMTN RSC Ltd.				
5,500 % éch. 28/04/2033	$	7 000	7 411	0,07
ROYAUME-UNI				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
PCL Funding PLC				
4,076 % éch. 15/10/2025	£	400	480	0,00
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AstraZeneca PLC				
5,315 % éch. 17/08/2023	$	400	400	0,00
Barclays PLC				
3,125 % éch. 17/01/2024	£	800	941	0,01
4,338 % éch. 16/05/2024	$	1 200	1 192	0,01
4,375 % éch. 12/01/2026		2 200	2 131	0,02
5,396 % éch. 26/06/2024	AUD	4 000	2 730	0,02
6,024 % éch. 16/05/2024	$	6 800	6 800	0,06
6,375 % éch. 15/12/2025 (f)(h)	£	4 300	4 755	0,04
7,750 % éch. 15/09/2023 (f)(h)	$	2 100	2 055	0,02
GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC				
3,125 % éch. 24/03/2025		16 600	15 800	0,14
HSBC Holdings PLC				
1,500 % éch. 04/12/2024	€	500	524	0,00
2,848 % éch. 04/06/2031	$	9 900	7 923	0,07
2,999 % éch. 10/03/2026		1 300	1 223	0,01
3,950 % éch. 18/05/2024		800	794	0,01
3,973 % éch. 22/05/2030	$	21 700	$ 19 037	0,17
4,041 % éch. 13/03/2028		7 300	6 738	0,06
4,150 % éch. 16/02/2024	AUD	4 000	2 710	0,02
4,583 % éch. 19/06/2029	$	19 600	18 080	0,16
4,755 % éch. 09/06/2028		11 200	10 604	0,09
5,210 % éch. 11/08/2028		19 400	18 748	0,16
5,674 % éch. 18/05/2024		6 900	6 875	0,06
Jaguar Land Rover Automotive PLC				
6,875 % éch. 15/11/2026	€	3 800	3 618	0,03
John Lewis PLC				
6,125 % éch. 21/01/2025	£	100	116	0,00
Lloyds Banking Group PLC				
4,650 % éch. 24/03/2026	$	1	0	0,00
4,947 % éch. 27/06/2025 (f)(h)	€	300	307	0,00
Nationwide Building Society				
1,700 % éch. 13/02/2023	$	11 700	11 663	0,10
2,972 % éch. 16/02/2028		8 800	7 747	0,07
3,766 % éch. 08/03/2024		400	398	0,00
4,363 % éch. 01/08/2024		11 200	11 056	0,10
5,750 % éch. 20/06/2027 (f)(h)	£	2 500	2 706	0,02
NatWest Group PLC				
4,445 % éch. 08/05/2030	$	4 775	4 334	0,04
5,076 % éch. 27/01/2030		19 200	18 126	0,16
NatWest Markets PLC				
1,000 % éch. 28/05/2024	€	7 721	7 951	0,07
Prudential PLC				
2,950 % éch. 03/11/2033	$	24 600	20 178	0,18
Rolls-Royce PLC				
3,625 % éch. 14/10/2025		200	185	0,00
Santander UK Group Holdings PLC				
3,373 % éch. 05/01/2024		7 000	7 000	0,06
4,750 % éch. 15/09/2025		600	572	0,01
4,796 % éch. 15/11/2024		20 100	19 769	0,17
Santander UK PLC				
3,782 % éch. 12/02/2027	£	16 900	20 301	0,18
Standard Chartered PLC				
0,991 % éch. 12/01/2025	$	13 400	12 665	0,11
1,822 % éch. 23/11/2025		28 100	25 684	0,23
2,608 % éch. 12/01/2028		12 700	11 032	0,10
2,678 % éch. 29/06/2032		600	454	0,00
Tesco Corporate Treasury Services PLC				
1,375 % éch. 24/10/2023	€	8 900	9 376	0,08
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % éch. 18/11/2028	£	9 800	8 689	0,08
Virgin Money UK PLC				
0,375 % éch. 27/05/2024	€	6 500	6 809	0,06
			340 796	2,98
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Alba PLC				
2,206 % éch. 15/12/2038		104	102	0,00
3,692 % éch. 15/12/2038	£	4 740	5 307	0,05
Avon Finance PLC				
4,331 % éch. 20/09/2048		22 037	26 007	0,23
Brass PLC				
3,965 % éch. 16/11/2066		4 961	5 977	0,05
Business Mortgage Finance PLC				
4,359 % éch. 15/02/2041		14	17	0,00
Canada Square Funding PLC				
4,205 % éch. 17/06/2058		19 163	22 188	0,19
4,375 % éch. 17/06/2058		301	355	0,00
4,675 % éch. 17/12/2057		4 768	5 666	0,05
Eurohome UK Mortgages PLC				
3,946 % éch. 15/06/2044		164	189	0,00
Eurosail PLC				
2,165 % éch. 13/03/2045	€	23	25	0,00
2,245 % éch. 13/03/2045		400	412	0,00
2,286 % éch. 15/12/2044		191	195	0,00
3,661 % éch. 13/03/2045	£	68	80	0,00
4,211 % éch. 13/09/2045		947	1 099	0,01
4,461 % éch. 13/06/2045		53	62	0,00
Finsbury Square PLC				
4,209 % éch. 16/03/2070		740	887	0,01
4,419 % éch. 16/12/2069		2 996	3 602	0,03
4,709 % éch. 16/06/2070		4 546	5 458	0,05

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Friary PLC				
3,993 % éch. 21/11/2067	£	810	$ 977	0,01
Great Hall Mortgages PLC				
2,192 % éch. 18/03/2039	€	351	369	0,00
2,212 % éch. 18/06/2038		232	244	0,00
3,785 % éch. 18/03/2039	£	4 670	5 189	0,05
4,868 % éch. 18/06/2039	$	61	59	0,00
Ludgate Funding PLC				
1,320 % éch. 01/01/2061	€	498	495	0,00
Mansard Mortgages PLC				
4,172 % éch. 15/12/2049	£	6 537	7 561	0,07
Newgate Funding PLC				
1,400 % éch. 01/12/2050	€	1 724	1 644	0,01
2,214 % éch. 01/12/2050		448	445	0,00
2,646 % éch. 15/12/2050		701	698	0,01
3,296 % éch. 15/12/2050		2 087	1 981	0,02
3,379 % éch. 01/12/2050	£	536	609	0,01
3,546 % éch. 15/12/2050	€	3 643	3 186	0,03
3,839 % éch. 01/12/2050	£	652	733	0,01
3,879 % éch. 01/12/2050		388	427	0,00
4,796 % éch. 15/12/2050		2 620	2 935	0,03
5,046 % éch. 15/12/2050		2 333	2 510	0,02
Paragon Mortgages PLC				
4,290 % éch. 15/05/2045		4 550	5 445	0,05
4,826 % éch. 15/11/2038	$	25	24	0,00
Polaris PLC				
4,222 % éch. 23/12/2058	£	7 736	9 079	0,08
Residential Mortgage Securities PLC				
4,681 % éch. 20/06/2070		17 954	21 519	0,19
Resloc UK PLC				
3,682 % éch. 15/12/2043		56	64	0,00
3,742 % éch. 15/12/2043		2 657	2 905	0,03
4,929 % éch. 15/12/2043	$	140	131	0,00
Ripon Mortgages PLC				
4,011 % éch. 28/08/2056	£	91 109	107 562	0,94
RMAC PLC				
4,206 % éch. 12/06/2046		20 368	24 378	0,21
4,476 % éch. 12/06/2046		10 629	12 738	0,11
RMAC Securities PLC				
2,240 % éch. 12/06/2044	€	896	900	0,01
3,656 % éch. 12/06/2044	£	375	417	0,00
3,676 % éch. 12/06/2044		254	280	0,00
Southern Pacific Financing PLC				
4,056 % éch. 10/03/2044		587	691	0,01
Stratton Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2060		46 712	55 712	0,49
4,287 % éch. 12/03/2052		17 027	20 399	0,18
Towd Point Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2045		24 180	28 776	0,25
4,071 % éch. 20/10/2051		15 061	18 011	0,16
Tower Bridge Funding PLC				
4,801 % éch. 20/09/2063		17 910	21 524	0,19
Trinity Square PLC				
3,729 % éch. 15/07/2059		16 633	19 777	0,17
Twin Bridges PLC				
4,237 % éch. 12/03/2055		12 112	14 253	0,12
4,386 % éch. 12/09/2050		172	207	0,00
Uropa Securities PLC				
3,116 % éch. 10/10/2040		57	65	0,00
Warwick Finance Residential Mortgages PLC				
0,000 % éch. 21/12/2049 (c)		1	5 691	0,05
4,387 % éch. 21/12/2049		37 857	45 537	0,40
5,087 % éch. 21/12/2049		7 280	8 757	0,08
5,587 % éch. 21/12/2049		3 640	4 378	0,04
6,087 % éch. 21/12/2049		2 080	2 502	0,02
6,587 % éch. 21/12/2049		2 080	2 502	0,02
			541 914	4,74

DESCRIPTION		ACTIONS		
TITRES PRIVILÉGIÉS				
Nationwide Building Society				
10,250 %		34 271	5 163	0,05

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Bon du Trésor britannique				
0,625 % éch. 22/10/2050	£	46 810	25 168	0,22
1,250 % éch. 31/07/2051		31 025	20 182	0,18
1,500 % éch. 31/07/2053	£	11 300	$ 7 801	0,07
			53 151	0,47
Total Royaume-Uni			941 504	8,24

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ÉTATS-UNIS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Accredited Mortgage Loan Trust				
4,649 % éch. 25/09/2036	$	1 542	1 513	0,01
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
4,509 % éch. 25/10/2036		4	2	0,00
4,519 % éch. 25/12/2036		6 198	3 549	0,03
4,689 % éch. 25/07/2036		2 179	818	0,01
5,184 % éch. 25/01/2035		752	682	0,01
5,289 % éch. 25/12/2034		977	875	0,01
5,289 % éch. 25/08/2035		4 445	4 251	0,04
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,139 % éch. 25/01/2036		600	583	0,01
5,364 % éch. 25/07/2035		800	757	0,01
5,439 % éch. 25/11/2034		678	662	0,01
Amortizing Residential Collateral Trust				
5,089 % éch. 25/10/2031		28	27	0,00
AMRESCO Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
5,329 % éch. 25/06/2029		46	43	0,00
Argent Securities Trust				
4,689 % éch. 25/07/2036		6 379	5 518	0,05
Asset-Backed Funding Certificates Trust				
5,089 % éch. 25/06/2034		246	231	0,00
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
5,004 % éch. 25/02/2036		2 469	2 396	0,02
5,029 % éch. 25/12/2034		7	7	0,00
5,049 % éch. 25/10/2032		6	6	0,00
5,214 % éch. 25/06/2036		11	11	0,00
5,389 % éch. 25/10/2037		104	104	0,00
5,389 % éch. 25/11/2042		20	19	0,00
5,394 % éch. 25/06/2035		1 447	1 381	0,01
5,439 % éch. 25/08/2037		2 214	1 982	0,02
Centex Home Equity Loan Trust				
4,849 % éch. 25/07/2032		17	15	0,00
CIT Mortgage Loan Trust				
5,739 % éch. 25/10/2037		2 594	2 582	0,02
Citigroup Mortgage Loan Trust				
4,449 % éch. 25/07/2045		63	45	0,00
4,809 % éch. 25/01/2037		463	451	0,00
5,764 % éch. 25/01/2037 ^		131	64	0,00
7,250 % éch. 25/05/2036		1 376	720	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
4,779 % éch. 25/06/2037		3 749	3 689	0,03
Countrywide Asset-Backed Certificates				
5,069 % éch. 25/12/2036 ^		121	90	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,529 % éch. 25/06/2037		1 464	1 341	0,01
4,529 % éch. 25/07/2037		772	697	0,01
4,529 % éch. 25/08/2037		1 632	1 601	0,01
4,589 % éch. 25/09/2047 ^		2 264	2 121	0,02
4,609 % éch. 25/08/2037		15 000	12 706	0,11
4,609 % éch. 25/09/2037 ^		466	478	0,00
4,609 % éch. 25/06/2047		13 443	12 818	0,11
4,649 % éch. 25/09/2046		3 570	3 384	0,03
4,709 % éch. 25/05/2047 ^		8 281	5 829	0,05
4,909 % éch. 25/12/2036 ^		6 110	5 673	0,05
5,049 % éch. 25/08/2035		2 031	1 977	0,02
5,079 % éch. 25/05/2036		3 127	3 088	0,03
5,229 % éch. 25/10/2047		2 857	2 757	0,02
5,364 % éch. 25/01/2036		4 992	4 817	0,04
5,439 % éch. 25/11/2034		77	76	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.				
5,109 % éch. 25/07/2034		121	119	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.				
5,270 % éch. 25/02/2035		252	231	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
4,598 % éch. 25/01/2032		13	13	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				
4,509 % éch. 25/11/2036		32	15	0,00
CSAB Mortgage-Backed Trust				
6,672 % éch. 25/06/2036 ^		212	63	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Delta Funding Home Equity Loan Trust				
4,513 % éch. 15/08/2030	$	10	$ 10	0,00
Ellington Loan Acquisition Trust				
5,489 % éch. 25/05/2037		335	322	0,00
EMC Mortgage Loan Trust				
5,129 % éch. 25/05/2040		13	12	0,00
Encore Credit Receivables Trust				
5,289 % éch. 25/01/2036		6 000	5 728	0,05
Fieldstone Mortgage Investment Trust				
4,256 % éch. 25/11/2036		2 062	1 215	0,01
First Franklin Mortgage Loan Trust				
4,499 % éch. 25/12/2037		2 796	2 602	0,02
5,109 % éch. 25/10/2035		80	79	0,00
Fremont Home Loan Trust				
4,524 % éch. 25/10/2036		2 305	2 035	0,02
4,529 % éch. 25/01/2037		2 440	1 223	0,01
5,454 % éch. 25/06/2035		5 787	5 512	0,05
GSAA Home Equity Trust				
4,849 % éch. 25/04/2047		319	162	0,00
4,869 % éch. 25/06/2036		2 902	934	0,01
4,989 % éch. 25/03/2037		293	123	0,00
4,989 % éch. 25/05/2047		117	79	0,00
GSAMP Trust				
4,519 % éch. 25/12/2046		8 248	4 448	0,04
4,529 % éch. 25/12/2036		6 023	3 265	0,03
4,619 % éch. 25/12/2046		7 226	3 625	0,03
4,669 % éch. 25/06/2036		153	146	0,00
4,889 % éch. 25/05/2046		500	469	0,00
5,064 % éch. 25/11/2035		2 803	2 627	0,02
Home Equity Asset Trust				
4,669 % éch. 25/08/2036		391	381	0,00
5,089 % éch. 25/12/2033		0	0	0,00
5,309 % éch. 25/02/2033		2	2	0,00
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
4,549 % éch. 25/11/2036		6 824	5 843	0,05
4,709 % éch. 25/04/2037		3 387	2 870	0,03
Home Equity Mortgage Trust				
6,000 % éch. 25/01/2037 ^		487	455	0,00
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
4,929 % éch. 25/02/2036		2 399	2 353	0,02
Humboldt Americas LLC				
0,000 % éch. 31/07/2022	COP	20 000 000	3 990	0,04
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
4,609 % éch. 25/08/2036	$	2 839	1 994	0,02
4,649 % éch. 25/08/2036		649	643	0,01
4,659 % éch. 25/08/2036		8 000	7 113	0,06
4,869 % éch. 25/04/2036		5 669	5 262	0,05
Lehman ABS Mortgage Loan Trust				
4,479 % éch. 25/06/2037		92	65	0,00
Long Beach Mortgage Loan Trust				
4,689 % éch. 25/05/2036		3 859	2 246	0,02
4,949 % éch. 25/10/2034		538	493	0,00
5,664 % éch. 25/02/2035		7 589	7 429	0,07
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
4,589 % éch. 25/08/2036		16 613	5 912	0,05
MASTR Specialized Loan Trust				
6,039 % éch. 25/06/2043		230	228	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
4,549 % éch. 25/09/2037		12	3	0,00
5,109 % éch. 25/05/2036		252	248	0,00
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
4,449 % éch. 25/05/2037		235	206	0,00
4,519 % éch. 25/01/2037		2 718	1 347	0,01
4,529 % éch. 25/10/2036		3 127	1 501	0,01
4,619 % éch. 25/10/2036		10 476	5 203	0,05
4,639 % éch. 25/07/2036		496	420	0,00
4,709 % éch. 25/09/2036		4 406	1 992	0,02
4,889 % éch. 25/04/2036		4 837	4 526	0,04
5,064 % éch. 25/09/2035		500	468	0,00
6,289 % éch. 25/02/2047		1 412	1 230	0,01
6,639 % éch. 25/03/2033		62	60	0,00
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				
4,559 % éch. 25/04/2037		3 737	2 047	0,02
4,619 % éch. 25/04/2037		11 424	6 350	0,06
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust				
4,439 % éch. 25/11/2036		2	1	0,00
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
4,849 % éch. 25/02/2037		182	50	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
5,109 % éch. 25/04/2037	$	301	$	90	0,00
5,750 % éch. 25/04/2037 ^		106		54	0,00
6,000 % éch. 25/02/2037 ^		143		89	0,00
Morgan Stanley Structured Trust					
4,619 % éch. 25/06/2037		58		58	0,00
New Century Home Equity Loan Trust					
3,740 % éch. 20/06/2031		181		155	0,00
5,124 % éch. 25/06/2035		491		491	0,00
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust					
5,019 % éch. 25/02/2036		4 400		3 978	0,04
Nomura Resecuritization Trust					
3,586 % éch. 26/12/2037		1 037		919	0,01
NovaStar Mortgage Funding Trust					
4,559 % éch. 25/01/2037		1 394		497	0,00
4,929 % éch. 25/05/2036		3 600		3 354	0,03
5,049 % éch. 25/01/2036		183		180	0,00
Option One Mortgage Loan Trust					
4,529 % éch. 25/01/2037		747		501	0,00
4,529 % éch. 25/03/2037		2 891		2 208	0,02
4,569 % éch. 25/04/2037		14 721		7 104	0,06
4,609 % éch. 25/04/2037		3 990		2 916	0,03
4,609 % éch. 25/05/2037		4 976		3 035	0,03
5,069 % éch. 25/11/2034		53		49	0,00
5,124 % éch. 25/08/2035		87		86	0,00
5,259 % éch. 25/05/2035		4 867		3 940	0,04
Ownit Mortgage Loan Trust					
4,316 % éch. 25/05/2037		1 629		1 225	0,01
Park Place Securities, Inc.					
5,124 % éch. 25/09/2035		200		195	0,00
People's Choice Home Loan Securities Trust					
5,366 % éch. 25/01/2035		135		128	0,00
PFS Financing Corp.					
1,000 % éch. 15/10/2025		14 700		14 176	0,12
Renaissance Home Equity Loan Trust					
5,089 % éch. 25/08/2032		1		1	0,00
5,340 % éch. 25/01/2037		15 587		5 129	0,05
5,879 % éch. 25/06/2037 ^		19 229		6 144	0,05
5,893 % éch. 25/06/2037 ^		9 958		3 189	0,03
Residential Asset Mortgage Products Trust					
4,609 % éch. 25/12/2036		681		667	0,01
5,069 % éch. 25/12/2035		3 720		3 233	0,03
Residential Asset Securities Corp. Trust					
5,094 % éch. 25/11/2035		600		573	0,01
Saxon Asset Securities Trust					
4,589 % éch. 25/05/2047		8 599		7 468	0,07
4,699 % éch. 25/09/2037		2 367		2 226	0,02
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust					
4,489 % éch. 25/12/2036		6		3	0,00
4,509 % éch. 25/12/2036 ^		83		19	0,00
4,519 % éch. 25/05/2037 ^		157		118	0,00
5,109 % éch. 25/10/2035		523		455	0,00
5,214 % éch. 25/10/2035		2 208		1 966	0,02
SG Mortgage Securities Trust					
4,709 % éch. 25/07/2036		3 156		733	0,01
SLM Student Loan Trust					
1,943 % éch. 25/10/2039	€	178		180	0,00
2,596 % éch. 15/12/2033		972		990	0,01
Soundview Home Loan Trust					
4,539 % éch. 25/03/2037	$	664		618	0,01
4,559 % éch. 25/07/2037		1 934		1 630	0,01
4,559 % éch. 25/08/2037		261		224	0,00
4,569 % éch. 25/07/2037		162		146	0,00
4,589 % éch. 25/06/2037		6 629		4 788	0,04
4,599 % éch. 25/06/2037		12 785		9 158	0,08
4,794 % éch. 25/12/2036		6 800		6 571	0,06
4,889 % éch. 25/10/2036		9 389		8 904	0,08
4,889 % éch. 25/11/2036		5 679		5 266	0,05
5,139 % éch. 25/03/2036		1 000		968	0,01
5,289 % éch. 25/10/2037		5 355		4 181	0,04
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust					
4,353 % éch. 25/12/2036		280		265	0,00
Structured Asset Investment Loan Trust					
5,009 % éch. 25/01/2036		3 033		2 720	0,02
5,664 % éch. 25/11/2034		1 953		1 846	0,02
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust					
4,524 % éch. 25/07/2036		251		247	0,00
5,620 % éch. 25/04/2035		8		8	0,00
Terwin Mortgage Trust					
0,116 % éch. 25/08/2037 ^	$	214	$	80	0,00
5,329 % éch. 25/11/2033		5		4	0,00
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust					
4,539 % éch. 25/01/2037		2 766		2 371	0,02
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust					
3,816 % éch. 25/10/2036		50		19	0,00
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust					
4,734 % éch. 25/01/2037		5 716		5 472	0,05
				334 432	2,93

OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
7-Eleven, Inc.					
0,800 % éch. 10/02/2024		12 300		11 710	0,10
AbbVie, Inc.					
1,500 % éch. 15/11/2023	€	1 200		1 265	0,01
Ally Financial, Inc.					
8,000 % éch. 01/11/2031	$	300		311	0,00
American Tower Corp.					
2,950 % éch. 15/01/2025		14 600		13 936	0,12
3,800 % éch. 15/08/2029		7 400		6 729	0,06
AT&T, Inc.					
2,822 % éch. 05/09/2023	€	100		107	0,00
Aviation Capital Group LLC					
4,125 % éch. 01/08/2025	$	23 600		22 042	0,19
Bank of America Corp.					
1,949 % éch. 27/10/2026	€	17 600		17 649	0,15
2,551 % éch. 04/02/2028	$	12 100		10 764	0,09
2,863 % éch. 24/08/2025	€	15 400		16 373	0,14
2,972 % éch. 04/02/2033	$	10 500		8 486	0,07
3,081 % éch. 22/09/2026	€	6 200		6 528	0,06
3,384 % éch. 02/04/2026	$	11 800		11 279	0,10
4,376 % éch. 27/04/2028		7 300		6 992	0,06
5,015 % éch. 22/07/2033		15 400		14 666	0,13
Bayer U.S. Finance LLC					
4,250 % éch. 15/12/2025		5 700		5 529	0,05
4,375 % éch. 15/12/2028		2 100		1 976	0,02
5,779 % éch. 15/12/2023		10 200		10 179	0,09
Boeing Co.					
1,167 % éch. 04/02/2023		13 100		13 050	0,11
1,433 % éch. 04/02/2024		3 700		3 547	0,03
1,950 % éch. 01/02/2024		36 000		34 696	0,30
2,750 % éch. 01/02/2026		1 300		1 206	0,01
3,250 % éch. 01/02/2028		6 200		5 641	0,05
3,625 % éch. 01/02/2031		19 000		16 695	0,15
British Airways Pass-Through Trust					
3,300 % éch. 15/06/2034		5 611		4 775	0,04
Broadcom, Inc.					
1,950 % éch. 15/02/2028		3 900		3 301	0,03
2,450 % éch. 15/02/2031		8 300		6 557	0,06
2,600 % éch. 15/02/2033		11 100		8 361	0,07
3,137 % éch. 15/11/2035		100		74	0,00
3,187 % éch. 15/11/2036		2 600		1 876	0,02
3,419 % éch. 15/04/2033		100		80	0,00
3,469 % éch. 15/04/2034		3 000		2 402	0,02
Campbell Soup Co.					
3,650 % éch. 15/03/2023		58		58	0,00
Charter Communications Operating LLC					
3,750 % éch. 15/02/2028		10 900		9 847	0,09
3,850 % éch. 01/04/2061		5 100		2 968	0,03
4,500 % éch. 01/02/2024		3 800		3 757	0,03
5,125 % éch. 01/07/2049		600		456	0,00
6,090 % éch. 01/02/2024		7 700		7 737	0,07
6,384 % éch. 23/10/2035		24 800		24 262	0,21
Citigroup, Inc.					
3,290 % éch. 17/03/2026 (i)		33 100		31 491	0,28
3,785 % éch. 17/03/2033 (i)		14 500		12 441	0,11
Comcast Corp.					
4,709 % éch. 15/04/2024		12 400		12 439	0,11
Conagra Brands, Inc.					
4,300 % éch. 01/05/2024		5 200		5 131	0,05
Corebridge Financial, Inc.					
3,500 % éch. 04/04/2025		7 500		7 196	0,06
Dell International LLC					
5,300 % éch. 01/10/2029		800		784	0,01
6,020 % éch. 15/06/2026		2 700		2 758	0,02
Doctors Co. An Interinsurance Exchange					
4,500 % éch. 18/01/2032		3 900		3 143	0,03
Energy Transfer LP					
4,500 % éch. 15/04/2024	$	1 300	$	1 282	0,01
Fidelity National Information Services, Inc.					
0,750 % éch. 21/05/2023	€	100		106	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC					
1,744 % éch. 19/07/2024		1 600		1 635	0,01
2,330 % éch. 25/11/2025		400		394	0,00
2,386 % éch. 17/02/2026		800		782	0,01
2,748 % éch. 14/06/2024	£	2 400		2 736	0,02
2,900 % éch. 16/02/2028	$	700		579	0,01
3,250 % éch. 15/09/2025	€	200		203	0,00
3,370 % éch. 17/11/2023	$	14 500		14 163	0,12
3,375 % éch. 13/11/2025		2 700		2 446	0,02
3,664 % éch. 08/09/2024		1 100		1 050	0,01
3,815 % éch. 02/11/2027		1 400		1 233	0,01
4,389 % éch. 08/01/2026		1 000		934	0,01
4,535 % éch. 06/03/2025	£	1 600		1 834	0,02
4,687 % éch. 09/06/2025	$	600		572	0,01
5,584 % éch. 18/03/2024		2 400		2 374	0,02
GA Global Funding Trust					
2,250 % éch. 06/01/2027		9 400		8 287	0,07
GLP Capital LP					
5,250 % éch. 01/06/2025		1 500		1 477	0,01
5,300 % éch. 15/01/2029		2 500		2 370	0,02
Goldman Sachs Group, Inc.					
0,010 % éch. 30/04/2024	€	18 600		19 621	0,17
0,250 % éch. 26/01/2028		10 300		9 024	0,08
1,250 % éch. 07/02/2029		8 000		7 114	0,06
2,732 % éch. 07/02/2025		6 800		7 242	0,06
4,223 % éch. 01/05/2029	$	3 400		3 174	0,03
4,598 % éch. 24/01/2025		19 000		18 724	0,16
Goodman U.S. Finance Three LLC					
3,700 % éch. 15/03/2028		6 600		5 967	0,05
HCA, Inc.					
5,375 % éch. 01/09/2026		2 170		2 149	0,02
5,875 % éch. 01/02/2029		500		499	0,00
Helmerich & Payne, Inc.					
2,900 % éch. 29/09/2031		100		81	0,00
Hyatt Hotels Corp.					
1,300 % éch. 01/10/2023		100		97	0,00
JetBlue Pass-Through Trust					
4,000 % éch. 15/05/2034		5 736		5 115	0,05
JPMorgan Chase & Co.					
2,595 % éch. 24/02/2026		21 600		20 325	0,18
3,797 % éch. 23/07/2024		13 291		13 162	0,12
4,080 % éch. 26/04/2026		33 800		32 847	0,29
Kilroy Realty LP					
3,450 % éch. 15/12/2024		1 800		1 724	0,02
Komatsu Finance America, Inc.					
0,849 % éch. 09/09/2023		500		485	0,00
Kraft Heinz Foods Co.					
2,000 % éch. 30/06/2023	€	2 800		2 979	0,03
Lehman Brothers Holdings, Inc.					
0,000 % éch. 25/05/2010 ^	$	8 800		33	0,00
5,625 % éch. 24/01/2013 ^		12 700		48	0,00
6,200 % éch. 26/09/2014 ^		9 800		37	0,00
7,875 % éch. 08/05/2018 ^	£	14 000		89	0,00
Morgan Stanley					
2,103 % éch. 08/05/2026	€	30 000		30 537	0,27
2,630 % éch. 18/02/2026	$	11 600		10 901	0,10
4,210 % éch. 20/04/2028		8 800		8 383	0,07
ONEOK, Inc.					
4,350 % éch. 15/03/2029		900		834	0,01
4,550 % éch. 15/07/2028		4 400		4 162	0,04
Oracle Corp.					
2,875 % éch. 25/03/2031 (i)		500		416	0,00
3,950 % éch. 25/03/2051 (i)		100		72	0,00
Organon & Co.					
2,875 % éch. 30/04/2028	€	3 400		3 189	0,03
4,125 % éch. 30/04/2028	$	4 900		4 347	0,04
Pacific Gas & Electric Co.					
2,100 % éch. 01/08/2027		500		428	0,00
2,950 % éch. 01/03/2026 ^		1 900		1 743	0,02
3,150 % éch. 01/01/2026		5 300		4 931	0,04
3,300 % éch. 01/12/2027 ^		800		707	0,01
3,400 % éch. 15/08/2024 ^		1 300		1 248	0,01
3,450 % éch. 01/07/2025		400		379	0,00
3,750 % éch. 01/07/2028		1 500		1 333	0,01

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
3,950 % éch. 01/12/2047 ^	$ 2 400	$ 1 636	0,01
4,000 % éch. 01/12/2046 ^	1 600	1 077	0,01
4,250 % éch. 15/03/2046 ^	800	560	0,01
4,300 % éch. 15/03/2045 ^	1 500	1 069	0,01
4,450 % éch. 15/04/2042 ^	1 900	1 421	0,01
4,500 % éch. 01/07/2040	800	628	0,01
4,550 % éch. 01/07/2030	3 100	2 817	0,03
4,600 % éch. 15/06/2043 ^	1 000	759	0,01
4,750 % éch. 15/02/2044 ^	200	154	0,00
4,950 % éch. 01/07/2050	600	467	0,00
Penske Truck Leasing Co. LP			
3,450 % éch. 01/07/2024	4 800	4 638	0,04
Principal Life Global Funding			
1,375 % éch. 10/01/2025	7 200	6 667	0,06
Sabine Pass Liquefaction LLC			
5,750 % éch. 15/05/2024	6 500	6 505	0,06
Southern California Edison Co.			
0,700 % éch. 03/04/2023	6 300	6 237	0,06
1,100 % éch. 01/04/2024	5 700	5 416	0,05
4,963 % éch. 03/04/2023	6 800	6 790	0,06
5,153 % éch. 01/04/2024	2 900	2 880	0,03
Southern Co. Gas Capital Corp.			
2,450 % éch. 01/10/2023	1 747	1 710	0,02
UnitedHealth Group, Inc.			
2,750 % éch. 15/02/2023	1 200	1 197	0,01
Virginia Electric & Power Co.			
2,750 % éch. 15/03/2023	500	498	0,00
Warner Media LLC			
1,950 % éch. 15/09/2023	€ 350	369	0,00
Wells Fargo & Co.			
3,908 % éch. 25/04/2026	$ 8 700	8 463	0,07
		723 811	6,34
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			
CenturyLink, Inc.			
6,634 % éch. 15/03/2027	9 201	8 755	0,08
Organon & Co.			
7,750 % éch. 02/06/2028	6 516	6 469	0,05
		15 224	0,13
OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX			
Obligations American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, (BABs), Series 2010			
6,270 % éch. 15/02/2050	95	101	0,00
Obligations American Municipal Power, Inc., Ohio Revenue Bonds, Series 2010			
7,734 % éch. 15/02/2033	100	114	0,00
7,834 % éch. 15/02/2041	1 700	2 082	0,02
Obligations Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021			
3,850 % éch. 01/06/2050	4 000	3 544	0,03
Billets Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, (ST APPROP Insured), Series 2021			
2,346 % éch. 01/06/2030	200	163	0,00
Billets Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021			
2,687 % éch. 01/06/2030	6 000	4 911	0,04
2,787 % éch. 01/06/2031	4 400	3 541	0,03
3,037 % éch. 01/06/2032	8 045	6 468	0,06
Obligations Los Angeles County, California Public Works Financing Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010			
7,618 % éch. 01/08/2040	2 800	3 444	0,03
Obligations Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABs), Series 2010			
6,655 % éch. 01/04/2057	289	313	0,00
Obligations New Jersey Transportation Trust Fund Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010			
5,754 % éch. 15/12/2028	200	202	0,00
Obligations New Jersey Transportation Trust Fund Authority Revenue Bonds, Series 2019			
4,081 % éch. 15/06/2039	6 180	5 127	0,05
		30 010	0,26
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Adjustable Rate Mortgage Trust			
3,361 % éch. 25/09/2035 ^	51	43	0,00
5,539 % éch. 25/03/2035	580	481	0,01
American Home Mortgage Assets Trust			
2,968 % éch. 25/11/2046	$ 7 471	$ 2 379	0,02
4,579 % éch. 25/05/2046 ^	267	217	0,00
4,599 % éch. 25/10/2046	66	36	0,00
4,769 % éch. 25/09/2046 ^	781	663	0,01
American Home Mortgage Investment Trust			
6,787 % éch. 25/09/2035	3 562	1 590	0,02
Banc of America Funding Trust			
3,860 % éch. 20/10/2046 ^	119	98	0,00
3,958 % éch. 20/02/2036	266	249	0,00
4,245 % éch. 20/11/2035 ^	92	81	0,00
4,273 % éch. 20/01/2047 ^	107	98	0,00
4,673 % éch. 20/02/2047	644	573	0,01
5,750 % éch. 25/11/2035	11	10	0,00
Banc of America Mortgage Trust			
4,045 % éch. 25/09/2033	7	6	0,00
4,330 % éch. 25/09/2035	5	4	0,00
BCAP LLC Trust			
2,427 % éch. 26/01/2047	281	263	0,00
4,729 % éch. 25/01/2037 ^	25	21	0,00
4,829 % éch. 25/05/2047 ^	172	161	0,00
5,250 % éch. 26/04/2037	564	338	0,00
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
2,634 % éch. 25/05/2034	71	60	0,00
3,236 % éch. 25/08/2033	6	6	0,00
3,255 % éch. 25/05/2047 ^	102	90	0,00
3,500 % éch. 25/08/2033	52	49	0,00
3,559 % éch. 25/05/2034	68	62	0,00
3,789 % éch. 25/10/2033	31	29	0,00
4,081 % éch. 25/02/2036 ^	42	35	0,00
4,089 % éch. 25/02/2034	8	7	0,00
6,800 % éch. 25/02/2036	51	49	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust			
3,115 % éch. 25/05/2035	44	41	0,00
3,374 % éch. 25/03/2036	264	159	0,00
3,383 % éch. 25/08/2036 ^	11	7	0,00
3,586 % éch. 25/11/2036 ^	2 728	1 461	0,01
3,668 % éch. 25/11/2036 ^	474	220	0,00
3,697 % éch. 25/08/2036 ^	1 258	670	0,01
3,729 % éch. 25/09/2035 ^	1 666	1 036	0,01
3,763 % éch. 25/11/2035 ^	626	502	0,01
3,787 % éch. 25/01/2036	1 684	1 570	0,01
4,709 % éch. 25/02/2034	117	104	0,00
5,109 % éch. 25/08/2035	10 260	9 276	0,08
Bear Stearns Mortgage Funding Trust			
4,549 % éch. 25/12/2046	364	308	0,00
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust			
5,219 % éch. 26/12/2046 ^	1 720	1 241	0,01
Chase Mortgage Finance Trust			
3,393 % éch. 25/03/2037 ^	551	503	0,01
3,492 % éch. 25/02/2037	146	141	0,00
3,718 % éch. 25/07/2037	40	33	0,00
3,824 % éch. 25/03/2037 ^	51	47	0,00
Citicorp Mortgage Securities Trust			
6,000 % éch. 25/04/2037 ^	65	53	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust			
3,885 % éch. 25/08/2035	74	72	0,00
3,950 % éch. 25/05/2035	7	7	0,00
4,156 % éch. 25/08/2036	9 659	4 033	0,04
5,410 % éch. 25/10/2035	9	8	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
3,790 % éch. 25/09/2035	120	116	0,00
4,575 % éch. 25/08/2035 ^	291	267	0,00
6,080 % éch. 25/09/2035	12	12	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates			
2,994 % éch. 25/09/2035 ^	510	435	0,00
CitiMortgage Alternative Loan Trust			
4,989 % éch. 25/02/2037	1 655	1 388	0,01
6,000 % éch. 25/01/2037 ^	317	280	0,00
Commercial Mortgage Trust			
0,593 % éch. 10/03/2046 (a)	21 812	1	0,00
3,545 % éch. 10/02/2036	28 500	26 093	0,23
3,590 % éch. 10/11/2047	15 500	14 954	0,13
Countrywide Alternative Loan Trust			
3,377 % éch. 25/10/2035 ^	9	8	0,00
3,548 % éch. 25/11/2035	333	282	0,00
4,088 % éch. 25/11/2035	257	223	0,00
4,533 % éch. 20/02/2047 ^	5 097	3 866	0,04
4,548 % éch. 20/12/2046 ^	$ 2 497	$ 2 011	0,02
4,563 % éch. 20/07/2046 ^	263	195	0,00
4,629 % éch. 25/06/2036	997	893	0,01
4,633 % éch. 20/09/2046	1 234	797	0,01
4,709 % éch. 25/02/2047	135	115	0,00
4,729 % éch. 25/05/2047	3 474	2 931	0,03
4,739 % éch. 25/05/2037 ^	533	200	0,00
4,773 % éch. 20/03/2046	1 670	1 304	0,01
4,789 % éch. 25/05/2036	73	61	0,00
4,809 % éch. 25/05/2035	33	29	0,00
4,809 % éch. 25/07/2046 ^	55	46	0,00
4,813 % éch. 20/05/2046 ^	2 558	2 117	0,02
4,849 % éch. 25/11/2036 ^	5 571	4 718	0,04
4,949 % éch. 25/02/2037	900	731	0,01
4,993 % éch. 20/11/2035	402	371	0,00
4,993 % éch. 20/12/2035	1 649	1 440	0,01
5,013 % éch. 20/11/2035	29	26	0,00
5,029 % éch. 25/11/2035	11	9	0,00
5,069 % éch. 25/10/2046 ^	805	591	0,01
5,139 % éch. 25/07/2036	281	130	0,00
5,250 % éch. 25/06/2035 ^	176	137	0,00
5,500 % éch. 25/09/2035 ^	856	638	0,01
5,500 % éch. 25/11/2035	1 542	1 060	0,01
5,750 % éch. 25/03/2037 ^	194	112	0,00
5,929 % éch. 25/11/2035	280	222	0,00
6,000 % éch. 25/03/2036	1 868	883	0,01
6,000 % éch. 25/02/2037 ^	186	85	0,00
6,250 % éch. 25/11/2036 ^	129	96	0,00
6,250 % éch. 25/08/2037 ^	477	260	0,00
6,500 % éch. 25/08/2032	3	3	0,00
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
2,980 % éch. 25/04/2035	140	108	0,00
3,302 % éch. 20/04/2036	1 006	893	0,01
3,501 % éch. 20/09/2036 ^	55	48	0,00
3,680 % éch. 25/08/2034 ^	4	4	0,00
3,792 % éch. 25/11/2034	146	132	0,00
3,914 % éch. 20/02/2036 ^	23	17	0,00
3,991 % éch. 25/09/2033 ^	11	9	0,00
4,366 % éch. 19/01/2034	34	31	0,00
4,849 % éch. 25/05/2035	421	340	0,00
4,969 % éch. 25/04/2035	204	177	0,00
5,029 % éch. 25/03/2035	1 125	945	0,01
5,049 % éch. 25/02/2035	244	217	0,00
5,069 % éch. 25/02/2035	95	79	0,00
5,089 % éch. 25/02/2036 ^	13	5	0,00
5,149 % éch. 25/09/2034	27	25	0,00
5,500 % éch. 25/11/2035 ^	63	33	0,00
5,750 % éch. 25/07/2037 ^	328	166	0,00
5,910 % éch. 20/02/2036 ^	35	30	0,00
6,000 % éch. 25/07/2036	298	170	0,00
6,000 % éch. 25/05/2037	1 066	512	0,01
6,500 % éch. 25/12/2037	672	312	0,00
6,500 % éch. 25/11/2047	508	271	0,00
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust			
4,749 % éch. 25/03/2035 ^	702	665	0,01
6,000 % éch. 25/03/2035 ^	46	43	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
3,792 % éch. 25/03/2032	39	35	0,00
6,500 % éch. 25/04/2033	4	4	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates			
3,139 % éch. 25/07/2033	6	6	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust			
5,579 % éch. 25/04/2037 ^	67	19	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Trust			
3,850 % éch. 25/09/2057	9 706	9 113	0,08
3,861 % éch. 25/06/2050	4 760	4 017	0,04
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust			
4,629 % éch. 25/08/2036 ^	1 690	1 516	0,01
4,689 % éch. 25/03/2037 ^	1 792	1 669	0,02
4,689 % éch. 25/09/2047 ^	2 747	2 322	0,02
4,719 % éch. 25/08/2037 ^	2 857	2 420	0,02
4,769 % éch. 25/08/2047	3 544	2 757	0,03
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust			
2,914 % éch. 25/10/2035	17	17	0,00
Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust			
4,489 % éch. 25/10/2036 ^	7	6	0,00
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust			
4,529 % éch. 19/10/2036	1 262	1 012	0,01
5,179 % éch. 19/09/2044	31	28	0,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust			
3,939 % éch. 25/04/2035	$ 85	$ 82	0,00
6,250 % éch. 25/11/2036 ^	161	60	0,00
6,250 % éch. 25/08/2037 ^	169	73	0,00
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust			
3,875 % éch. 25/08/2035	52	36	0,00
Greenpoint Mortgage Funding Trust			
4,749 % éch. 25/01/2037	656	555	0,01
4,809 % éch. 25/04/2036	295	246	0,00
4,829 % éch. 25/06/2045	52	47	0,00
4,929 % éch. 25/04/2036 ^	193	176	0,00
4,929 % éch. 25/11/2045	105	95	0,00
5,029 % éch. 25/09/2046 ^	1 019	790	0,01
5,069 % éch. 25/10/2046 ^	1 279	871	0,01
GreenPoint Mortgage Funding Trust Pass-Through Certificates			
3,726 % éch. 25/10/2033	7	6	0,00
GS Mortgage Securities Corp. Trust			
5,468 % éch. 15/07/2031	5 000	4 775	0,04
GSMSC Pass-Through Trust			
7,500 % éch. 25/10/2036	52	12	0,00
GSR Mortgage Loan Trust			
2,880 % éch. 25/03/2033	21	21	0,00
3,028 % éch. 25/06/2034	20	20	0,00
3,061 % éch. 25/11/2035	15	15	0,00
3,760 % éch. 25/04/2032	78	66	0,00
3,767 % éch. 25/09/2035	39	36	0,00
3,796 % éch. 25/01/2036 ^	39	38	0,00
4,619 % éch. 25/05/2037	10 038	5 600	0,05
5,500 % éch. 25/01/2037	136	166	0,00
6,000 % éch. 25/03/2032	0	0	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust			
2,898 % éch. 19/12/2036 ^	297	243	0,00
3,275 % éch. 19/07/2035 ^	53	39	0,00
3,321 % éch. 19/08/2036 ^	42	38	0,00
4,048 % éch. 19/10/2035	387	221	0,00
4,529 % éch. 19/09/2037	516	443	0,01
4,739 % éch. 19/09/2046 ^	606	545	0,01
4,749 % éch. 19/12/2036	8 810	7 265	0,06
4,819 % éch. 19/03/2036 ^	120	104	0,00
4,839 % éch. 19/01/2036	325	198	0,00
5,039 % éch. 19/01/2035	92	80	0,00
5,839 % éch. 19/10/2035	235	156	0,00
HomeBanc Mortgage Trust			
4,749 % éch. 25/12/2036	2	2	0,00
HSI Asset Loan Obligation Trust			
6,000 % éch. 25/06/2037 ^	35	30	0,00
Impac CMB Trust			
5,029 % éch. 25/03/2035	7	6	0,00
5,389 % éch. 25/07/2033	5	5	0,00
Impac Secured Assets Trust			
4,909 % éch. 25/01/2037	4 274	3 662	0,03
IndyMac Mortgage Loan Trust			
2,895 % éch. 25/01/2036 ^	43	39	0,00
3,014 % éch. 25/03/2036	511	348	0,00
3,038 % éch. 25/10/2035	103	81	0,00
3,082 % éch. 25/03/2036 ^	1 904	1 341	0,01
3,129 % éch. 25/06/2036	166	130	0,00
3,229 % éch. 25/08/2035 ^	94	75	0,00
3,837 % éch. 25/12/2034	49	47	0,00
4,749 % éch. 25/02/2037 ^	1 535	1 349	0,01
4,789 % éch. 25/06/2046	953	741	0,01
4,869 % éch. 25/06/2037	115	100	0,00
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust			
0,620 % éch. 15/04/2047 (a)	27 783	146	0,00
JPMorgan Alternative Loan Trust			
4,141 % éch. 25/12/2035 ^	700	510	0,01
4,529 % éch. 27/06/2037	146	109	0,00
4,869 % éch. 25/10/2036	3 070	2 695	0,02
5,500 % éch. 25/11/2036 ^	12	5	0,00
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust			
0,944 % éch. 15/12/2047 (a)	13 127	0	0,00
JPMorgan Mortgage Trust			
3,062 % éch. 25/11/2033	58	54	0,00
3,357 % éch. 25/06/2036 ^	216	159	0,00
3,381 % éch. 25/02/2036 ^	415	325	0,00
3,453 % éch. 25/07/2035	88	84	0,00
3,478 % éch. 25/02/2036 ^	137	102	0,00
3,569 % éch. 25/07/2035	39	36	0,00
3,747 % éch. 25/08/2034	$ 95	$ 91	0,00
3,834 % éch. 25/12/2034	187	176	0,00
Lehman XS Trust			
4,749 % éch. 25/12/2036	2 592	2 434	0,02
4,849 % éch. 25/05/2046	520	667	0,01
Luminent Mortgage Trust			
4,749 % éch. 25/12/2036 ^	227	204	0,00
4,789 % éch. 25/10/2046	380	329	0,00
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			
3,874 % éch. 21/11/2034	85	77	0,00
MASTR Alternative Loan Trust			
4,789 % éch. 25/03/2036 ^	677	77	0,00
MASTR Asset Securitization Trust			
6,000 % éch. 25/06/2036 ^	153	102	0,00
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Certificates			
5,018 % éch. 15/11/2031	56	54	0,00
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust			
4,392 % éch. 20/10/2029	18	18	0,00
4,758 % éch. 15/12/2030	48	44	0,00
Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust			
4,709 % éch. 25/01/2037	8 868	2 826	0,03
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
3,139 % éch. 25/12/2034	147	137	0,00
3,242 % éch. 25/06/2037	15	15	0,00
3,418 % éch. 25/02/2033	69	63	0,00
5,049 % éch. 25/06/2028	17	15	0,00
Merrill Lynch Mortgage-Backed Securities Trust			
2,861 % éch. 25/04/2037 ^	754	665	0,01
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust			
0,866 % éch. 15/02/2046 (a)	3 728	0	0,00
3,732 % éch. 15/05/2048	8 100	7 709	0,07
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
2,980 % éch. 25/11/2037	489	320	0,00
3,544 % éch. 25/11/2035 ^	25	19	0,00
4,649 % éch. 25/04/2035	200	186	0,00
MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
4,849 % éch. 25/06/2047	4 156	3 355	0,03
New Century Alternative Mortgage Loan Trust			
6,173 % éch. 25/07/2036	4 936	1 171	0,01
New Residential Mortgage Loan Trust			
3,500 % éch. 25/12/2057	2 327	2 203	0,02
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust			
3,189 % éch. 25/10/2035	32	20	0,00
NovaStar Mortgage Funding Trust			
0,412 % éch. 25/09/2046	1 351	473	0,01
Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
3,483 % éch. 25/11/2037	1 681	1 368	0,01
3,732 % éch. 25/08/2035 ^	39	15	0,00
4,539 % éch. 25/02/2047	410	151	0,00
4,689 % éch. 25/06/2037 ^	1 068	954	0,01
4,709 % éch. 25/03/2047	1 552	1 366	0,01
4,749 % éch. 25/06/2046	4 580	1 067	0,01
4,809 % éch. 25/04/2046	3 480	1 032	0,01
4,889 % éch. 25/08/2037	525	467	0,01
6,000 % éch. 25/06/2036	385	311	0,00
Residential Asset Securitization Trust			
4,789 % éch. 25/01/2046 ^	11	3	0,00
5,750 % éch. 25/02/2036	1 830	1 406	0,01
5,750 % éch. 25/04/2037 ^	1 127	597	0,01
6,000 % éch. 25/07/2037 ^	772	312	0,00
6,500 % éch. 25/08/2036 ^	1 104	372	0,00
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust			
3,910 % éch. 25/09/2035 ^	226	141	0,00
6,500 % éch. 25/03/2032	8	7	0,00
Sequoia Mortgage Trust			
2,976 % éch. 20/01/2047 ^	284	191	0,00
3,194 % éch. 20/07/2037	683	549	0,01
4,272 % éch. 20/04/2035	32	31	0,00
5,039 % éch. 19/10/2026	27	26	0,00
5,053 % éch. 20/07/2033	158	144	0,00
5,113 % éch. 20/10/2027	2	2	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
3,530 % éch. 25/11/2035 ^	47	41	0,00
3,678 % éch. 25/08/2035	101	86	0,00
3,688 % éch. 25/07/2035 ^	818	696	0,01
3,780 % éch. 25/02/2034	58	54	0,00
3,944 % éch. 25/09/2034	$ 199	$ 187	0,00
3,957 % éch. 25/04/2034	80	79	0,00
3,980 % éch. 25/09/2034	5	5	0,00
4,132 % éch. 25/12/2035	423	317	0,00
4,709 % éch. 25/10/2035	372	340	0,00
4,829 % éch. 25/05/2037	9	8	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust			
3,278 % éch. 25/05/2047 ^	2 451	1 953	0,02
3,448 % éch. 25/12/2035 ^	74	58	0,00
3,548 % éch. 25/08/2047 ^	1 234	1 083	0,01
4,509 % éch. 25/08/2036	1 596	1 342	0,01
4,569 % éch. 25/01/2037	2 074	1 785	0,02
4,569 % éch. 25/09/2047	1 586	1 427	0,01
4,609 % éch. 25/09/2047	23	19	0,00
4,709 % éch. 25/01/2037	1 178	1 021	0,01
4,769 % éch. 25/06/2036	43	41	0,00
4,789 % éch. 25/10/2036	2 489	2 101	0,02
4,809 % éch. 25/05/2036	447	338	0,00
4,809 % éch. 25/09/2047 ^	2 178	1 739	0,02
4,829 % éch. 25/05/2036	2 361	1 807	0,02
4,829 % éch. 25/05/2046	2 483	743	0,01
4,839 % éch. 19/07/2035	32	29	0,00
4,909 % éch. 25/05/2046 ^	50	28	0,00
4,919 % éch. 19/07/2034	25	23	0,00
4,949 % éch. 25/02/2036 ^	308	239	0,00
4,999 % éch. 19/09/2032	23	22	0,00
5,039 % éch. 19/03/2034	5	5	0,00
Structured Asset Securities Corp.			
4,669 % éch. 25/01/2036	71	68	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
4,679 % éch. 25/10/2036	534	468	0,01
TBW Mortgage-Backed Trust			
6,130 % éch. 25/01/2037 ^	27	9	0,00
Thornburg Mortgage Securities Trust			
2,994 % éch. 25/09/2037	20	20	0,00
5,639 % éch. 25/06/2037 ^	570	493	0,01
6,616 % éch. 25/06/2037	1 304	1 088	0,01
6,666 % éch. 25/06/2037	1 577	1 413	0,01
6,666 % éch. 25/06/2047 ^	1 019	873	0,01
6,666 % éch. 25/06/2047	5	5	0,00
6,716 % éch. 25/03/2037 ^	711	592	0,01
Towd Point Mortgage Trust			
3,750 % éch. 25/05/2058	10 153	9 616	0,09
5,389 % éch. 25/10/2059	6 643	6 579	0,06
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust			
0,775 % éch. 10/03/2046 (a)	9 490	0	0,00
Verus Securitization Trust			
1,829 % éch. 25/10/2066	6 785	5 725	0,05
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
2,335 % éch. 25/03/2033	8	7	0,00
2,499 % éch. 25/12/2046	20	18	0,00
2,585 % éch. 25/03/2034	5	5	0,00
2,810 % éch. 25/08/2035	26	23	0,00
2,835 % éch. 27/02/2034	73	68	0,00
2,928 % éch. 25/10/2046 ^	2 331	1 949	0,02
3,028 % éch. 25/06/2046	576	532	0,01
3,048 % éch. 25/02/2046	1 478	1 301	0,01
3,048 % éch. 25/08/2046	74	67	0,00
3,122 % éch. 25/03/2036	49	44	0,00
3,206 % éch. 25/06/2033	35	33	0,00
3,222 % éch. 25/03/2036 ^	1 108	969	0,01
3,248 % éch. 25/11/2042	30	27	0,00
3,298 % éch. 25/01/2047	341	304	0,00
3,342 % éch. 25/05/2037 ^	1 464	1 275	0,01
3,347 % éch. 25/05/2037 ^	1 048	822	0,01
3,448 % éch. 25/08/2042	0	0	0,00
3,510 % éch. 25/12/2036 ^	456	395	0,00
3,548 % éch. 25/10/2046	9	8	0,00
3,565 % éch. 25/09/2036	235	201	0,00
3,738 % éch. 25/09/2036 ^	2 878	2 597	0,02
3,836 % éch. 25/12/2035	246	222	0,00
3,897 % éch. 25/08/2034	64	60	0,00
4,124 % éch. 25/09/2033	5	5	0,00
4,180 % éch. 25/09/2033	10	9	0,00
4,849 % éch. 25/04/2045	16	15	0,00
4,929 % éch. 25/12/2045	16	15	0,00
4,969 % éch. 25/07/2045	248	227	0,00
4,969 % éch. 25/10/2045	74	69	0,00
5,009 % éch. 25/01/2045	147	141	0,00
5,029 % éch. 25/01/2045	45	42	0,00
5,129 % éch. 25/11/2034	173	156	0,00

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
5,209 % éch. 25/11/2045	$ 283	$ 248	0,00
5,209 % éch. 25/12/2045	3 468	3 051	0,03
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
2,988 % éch. 25/07/2046 ^	459	282	0,00
4,839 % éch. 25/04/2035	129	106	0,00
4,989 % éch. 25/07/2036 ^	68	43	0,00
Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
3,984 % éch. 25/06/2033	4	3	0,00
Wells Fargo Alternative Loan Trust			
4,796 % éch. 28/12/2037 ^	260	236	0,00
6,250 % éch. 25/07/2037 ^	431	361	0,00
		259 261	2,27
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Fannie Mae			
2,560 % éch. 01/08/2036	1	1	0,00
2,888 % éch. 01/06/2043	4	4	0,00
2,889 % éch. 01/11/2042 - 01/10/2044	50	48	0,00
3,000 % éch. 01/03/2060	8 498	7 492	0,07
3,089 % éch. 01/09/2040	16	16	0,00
3,248 % éch. 01/06/2035	2	2	0,00
3,257 % éch. 25/05/2035	1	1	0,00
3,377 % éch. 01/01/2033	26	26	0,00
3,465 % éch. 01/10/2034	1	1	0,00
3,500 % éch. 01/01/2059	24 547	22 550	0,20
3,632 % éch. 01/12/2034	38	38	0,00
3,644 % éch. 25/12/2036	186	183	0,00
3,650 % éch. 01/10/2034	16	15	0,00
3,832 % éch. 01/08/2033	22	22	0,00
4,027 % éch. 01/11/2034	283	291	0,00
4,086 % éch. 01/04/2033	36	37	0,00
4,295 % éch. 01/04/2033 - 01/08/2035	126	125	0,00
4,366 % éch. 25/09/2042	39	38	0,00
4,509 % éch. 25/03/2034	34	34	0,00
4,539 % éch. 25/08/2034	15	14	0,00
4,633 % éch. 01/12/2030	1	1	0,00
4,739 % éch. 25/03/2044	5	5	0,00
4,789 % éch. 25/06/2029 - 25/06/2036	223	219	0,00
5,039 % éch. 25/09/2023	0	0	0,00
6,000 % éch. 25/04/2043 - 25/07/2044	652	658	0,01
6,500 % éch. 01/11/2036	78	77	0,00
7,000 % éch. 01/11/2036 - 25/07/2042	115	119	0,00
Freddie Mac			
2,889 % éch. 25/02/2045	66	67	0,00
3,000 % éch. 01/11/2026 - 01/04/2045	379	346	0,00
3,248 % éch. 25/10/2044	925	922	0,01
3,448 % éch. 25/07/2044	22	22	0,00
3,500 % éch. 01/08/2026 - 01/04/2049	5 426	5 041	0,04
3,756 % éch. 01/09/2037	115	117	0,00
3,879 % éch. 01/10/2034	21	21	0,00
3,981 % éch. 01/08/2035	20	20	0,00
4,000 % éch. 01/09/2024 - 01/09/2041	4	3	0,00
4,021 % éch. 01/09/2035	13	13	0,00
4,344 % éch. 01/10/2033	19	19	0,00
4,649 % éch. 25/08/2031	0	0	0,00
4,669 % éch. 25/09/2031	44	44	0,00
4,768 % éch. 15/12/2031	0	0	0,00
4,798 % éch. 15/10/2040	1 757	1 720	0,02
4,818 % éch. 15/06/2041	2 624	2 576	0,02
4,918 % éch. 15/12/2037	65	65	0,00
5,000 % éch. 15/08/2035 - 01/12/2039	486	485	0,01
5,500 % éch. 01/06/2037 - 01/10/2039	44	46	0,00
6,000 % éch. 15/04/2036	1 293	1 341	0,01
7,000 % éch. 01/10/2037	7	7	0,00
Ginnie Mae			
1,750 % éch. 20/11/2026	1	0	0,00
2,625 % éch. 20/09/2023 - 20/01/2030	6	5	0,00
2,872 % éch. 20/01/2066	1 599	1 572	0,01
2,875 % éch. 20/04/2027 - 20/05/2030	$ 8	$ 7	0,00
3,000 % éch. 20/04/2030 - 20/05/2047	416	397	0,00
4,500 % éch. 15/04/2039	23	23	0,00
4,672 % éch. 20/08/2066	4 172	4 129	0,04
5,000 % éch. 20/04/2038	13	13	0,00
5,500 % éch. 20/08/2035 - 15/02/2039	174	176	0,00
Administration des petites entreprises			
4,760 % éch. 01/09/2025	13	12	0,00
4,840 % éch. 01/05/2025	6	6	0,00
5,090 % éch. 01/10/2025	6	6	0,00
5,110 % éch. 01/04/2025	1	1	0,00
5,490 % éch. 01/05/2028	16	15	0,00
5,600 % éch. 01/09/2028	6	6	0,00
5,680 % éch. 01/06/2028	3	3	0,00
6,220 % éch. 01/12/2028	43	44	0,00
Tennessee Valley Authority			
5,880 % éch. 01/04/2036	500	549	0,01
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)			
2,500 % éch. 01/05/2030 - 01/01/2052	58 997	50 410	0,44
3,000 % éch. 01/01/2027 - 01/06/2051	27 096	24 010	0,21
3,500 % éch. 01/11/2034 - 01/07/2050	34 360	31 844	0,28
4,000 % éch. 01/01/2026 - 01/10/2052	22 496	21 280	0,19
4,500 % éch. 01/08/2023 - 01/09/2052	9 726	9 399	0,08
5,500 % éch. 01/06/2023 - 01/11/2039	36	38	0,00
6,500 % éch. 01/06/2036 - 01/06/2037	12	13	0,00
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
2,500 % éch. 01/02/2053	238 050	201 838	1,77
3,000 % éch. 01/01/2053	648 300	569 599	4,99
3,500 % éch. 01/01/2053	364 500	331 403	2,90
4,000 % éch. 01/01/2053	412 258	386 879	3,39
4,500 % éch. 01/01/2053	641 400	617 467	5,42
6,000 % éch. 01/02/2053	80 100	81 238	0,71
		2 377 274	20,83
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Obligations du Trésor américain			
1,375 % éch. 15/11/2040	61 050	39 723	0,35
1,625 % éch. 15/11/2050	117 170	69 760	0,61
1,875 % éch. 15/02/2041	320 000	226 350	1,98
1,875 % éch. 15/02/2051	100	64	0,00
2,000 % éch. 15/08/2051	7 100	4 651	0,04
2,875 % éch. 15/05/2052	26 900	21 562	0,19
3,250 % éch. 15/05/2042	200	175	0,00
4,000 % éch. 15/11/2052	38 080	38 145	0,34
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e)			
0,125 % éch. 15/07/2031	35 354	31 263	0,28
0,125 % éch. 15/01/2032	9 137	8 010	0,07
0,375 % éch. 15/01/2027	43 174	40 728	0,36
0,375 % éch. 15/07/2027	158	149	0,00
0,500 % éch. 15/01/2028	86 523	81 401	0,71
0,625 % éch. 15/07/2032	5 435	4 983	0,04
0,750 % éch. 15/07/2028	9 140	8 711	0,08
1,750 % éch. 15/01/2028	25 175	25 170	0,22
2,375 % éch. 15/01/2027	1 478	1 508	0,01
2,500 % éch. 15/01/2029	55 931	58 346	0,51
3,875 % éch. 15/04/2029	35 889	40 346	0,35
Billets du Trésor américain			
2,500 % éch. 31/03/2027	4 600	4 318	0,03
2,875 % éch. 31/10/2023	990	975	0,01
2,875 % éch. 30/04/2025	96 500	93 405	0,82
		799 743	7,00
Total États-Unis		4 539 755	39,76
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BONS DU TRÉSOR HONGROIS			
18,250 % éch. 03/01/2023 (c)(d)	HUF 32 085 000	$ 85 511	0,75
BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN			
0,506 % éch. 08/02/2023 (c)(d)	ILS 616 388	174 054	1,52
0,753 % éch. 05/04/2023 (c)(d)	88 200	24 762	0,22
0,875 % éch. 03/05/2023 (c)(d)	75 100	21 035	0,18
0,913 % éch. 05/04/2023 (c)(d)	65 600	18 417	0,16
0,950 % éch. 05/04/2023 (c)(d)	21 900	6 148	0,05
1,716 % éch. 05/07/2023 (c)(d)	18 700	5 201	0,05
1,783 % éch. 03/05/2023 (c)(d)	30 800	8 627	0,08
		258 244	2,26
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS			
(0,262) % éch. 11/01/2023 (c)(d)	¥ 6 145 000	46 574	0,41
(0,256) % éch. 11/01/2023 (c)(d)	5 468 900	41 450	0,36
(0,255) % éch. 11/01/2023 (c)(d)	4 247 100	32 190	0,28
(0,251) % éch. 11/01/2023 (c)(d)	2 786 200	21 117	0,19
(0,240) % éch. 11/01/2023 (c)(d)	15 000 000	113 688	1,00
(0,232) % éch. 11/01/2023 (c)(d)	6 330 000	47 976	0,42
(0,228) % éch. 11/01/2023 (c)(d)	6 352 800	48 149	0,42
(0,203) % éch. 16/01/2023 (c)(d)	3 002 000	22 753	0,20
(0,190) % éch. 16/01/2023 (c)(d)	2 838 000	21 510	0,19
(0,182) % éch. 20/03/2023 (c)(d)	1 103 000	8 363	0,07
(0,175) % éch. 20/03/2023 (c)(d)	9 187 000	69 653	0,61
(0,160) % éch. 23/01/2023 (c)(d)	3 618 000	27 423	0,24
(0,160) % éch. 30/01/2023 (c)(d)	3 423 000	25 946	0,23
(0,151) % éch. 23/01/2023 (c)(d)	1 752 000	13 280	0,12
(0,149) % éch. 30/01/2023 (c)(d)	1 567 000	11 878	0,10
(0,147) % éch. 06/02/2023 (c)(d)	9 360 000	70 951	0,62
(0,146) % éch. 06/02/2023 (c)(d)	7 400 000	56 094	0,49
(0,138) % éch. 06/02/2023 (c)(d)	20 000 000	151 604	1,33
(0,129) % éch. 13/02/2023 (c)(d)	11 647 600	88 294	0,77
(0,125) % éch. 13/02/2023 (c)(d)	24 770 000	187 769	1,64
(0,124) % éch. 27/02/2023 (c)(d)	3 664 000	27 777	0,24
(0,118) % éch. 13/02/2023 (c)(d)	12 472 400	94 547	0,83
(0,117) % éch. 20/02/2023 (c)(d)	23 470 000	177 920	1,56
(0,117) % éch. 27/02/2023 (c)(d)	27 036 000	204 961	1,79
		1 611 867	14,11
Total des Instruments à court terme		1 955 622	17,12
Total des Valeurs mobilières		**$ 11 361 097**	**99,49**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (g)	5 290 441	$ 53 010	0,46
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (g)	1 355 380	14 292	0,13
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Global Bond Ex-US Fund (g)	10 956 929	104 748	0,92
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds UK Corporate Bond Fund (g)	7 715 431	79 259	0,69
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds US Short-Term Fund (g)	330 807	3 302	0,03
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	6 338 731	$ 63 096	0,55
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (g)	345 274	4 599	0,04
		322 306	2,82
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (g)	3 455 880	356 374	3,12
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)	4 464 740	442 299	3,88
		798 673	7,00
Total des Fonds d'investissement		**$ 1 120 979**	**9,82**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BPS	4,200 %	03/01/2023	04/01/2023	$ 660 000	Billets du Trésor américain 0,125 % - 1,375 % échéance 15/01/2024 - 15/11/2031	$ (674 208)	$ 660 000	$ 660 077	5,77
CIB	4,260	30/12/2022	03/01/2023	562 700	Obligations du Trésor américain 2,000 % échéance 15/08/2051	(307 187)	562 700	562 966	4,93
					Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/10/2024 - 15/01/2031	(269 857)			
FICC	1,900	30/12/2022	03/01/2023	11 570	Billets du Trésor américain 0,125 % échéance 15/05/2023	(11 801)	11 570	11 571	0,10
	4,280	30/12/2022	03/01/2023	112 700	Billets du Trésor américain 2,000 % - 4,275 % échéance 30/04/2024	(114 954)	112 700	112 754	0,99
Total des Contrats de mise en pension						**$ (1 378 007)**	**$ 1 346 970**	**$ 1 347 368**	**11,79**

(1) Comprend les intérêts courus.

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

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

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2024	10 716	$ 4 303	0,04
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Long	09/2023	6 398	(4 390)	(0,04)
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Long	09/2024	5 358	(1 709)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans mars	Court	03/2023	1 037	995	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars	Long	03/2023	1 225	(5 388)	(0,05)
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	131	105	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars	Court	03/2023	1 057	1 743	0,02
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Court	03/2023	3 178	12 301	0,11
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	Court	03/2023	3 157	7 146	0,06
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	394	3 204	0,03
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	Long	03/2023	17	(464)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars	Court	03/2023	4 842	47 543	0,42
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Long	03/2023	95	(1 985)	(0,02)
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	131	(670)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Court	03/2023	42	(11)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	10 307	(1 967)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	2 308	(2 149)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Court	03/2023	11	(1)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Long	03/2023	5	4	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	5 440	4 096	0,04
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Court	03/2023	1 352	8 947	0,08
				$ 71 653	0,63

(1) Option de style contrat à terme standardisé.

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Nbre de Contrats	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	$ 98,000	15/12/2023	222	$ 0	$ (19)	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	222	0	(673)	(0,01)
				$ 0	$ (692)	(0,01)

Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé **$ 70 961 0,62**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

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

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AT&T, Inc.	1,000 %	20/12/2023	$ 5 900	$ (65)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2027	€ 5 700	(80)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/06/2028	5 700	(168)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2026	$ 800	17	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20/06/2026	€ 17 500	(3 378)	(0,03)
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2024	7 400	(112)	0,00
Tesco PLC	1,000	20/06/2025	2 900	105	0,00
				$ (3 681)	(0,03)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION[2]

Indices/Tranches	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.IG-38 à 10 ans	(1,000) %	20/06/2032	$ 23 125	$ (224)	0,00
Indice CDX.IG-39 à 10 ans	(1,000)	20/12/2032	785 500	(9 983)	(0,09)
Indice iTraxx Europe Main 37 à 10 ans	(1,000)	20/06/2032	€ 72 400	(1 021)	(0,01)
Indice iTraxx Europe Main 38 à 10 ans	(1,000)	20/12/2032	116 900	(2 764)	(0,03)
				$ (13 992)	(0,13)

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT - SWAPS DE BASE

Indice de taux variable à payer	Indice de taux variable à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,070 %	07/03/2024	$ 110 900	$ 92	0,00
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,073 %	27/04/2023	339 800	229	0,00
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,086 %	12/04/2023	400	0	0,00
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,088 %	06/09/2024	611 900	462	0,01
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,102 %	04/10/2024	300 600	59	0,00
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,105 %	27/09/2024	350 000	118	0,00
				$ 960	0,01

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	0,010 %	07/02/2023	£ 579 800	$ (11 587)	(0,10)
À payer[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2033	289 700	(3 846)	(0,03)
À payer[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053	32 000	(1 366)	(0,01)
À payer[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250	15/03/2028	65 700	(2 324)	(0,02)
À recevoir[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,500	15/03/2025	118 200	1 500	0,01
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	5,750	16/03/2027	INR 17 547 860	(3 564)	(0,03)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250	21/09/2023	41 579 150	(1 664)	(0,01)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250	21/09/2024	6 508 260	(201)	0,00
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250	16/03/2032	1 797 200	(858)	(0,01)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,500	21/09/2024	8 580 695	421	0,00
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,500	21/09/2027	4 115 600	(497)	0,00
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,750	21/09/2024	19 925 550	1 250	0,01
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	7,000	21/09/2027	4 391 900	(1 051)	(0,01)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	17/03/2031	¥ 14 710 000	(6 406)	(0,06)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,050	15/12/2031	18 270 000	(5 407)	(0,05)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,200	19/06/2029	6 440 000	(2 885)	(0,03)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	19/06/2039	13 160 000	12 134	0,11
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,800	15/06/2052	3 460 000	3 227	0,03
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/09/2031	SGD 510	(19)	0,00
À recevoir	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/09/2031	510	11	0,00
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	2,500	21/09/2027	75 800	(1 367)	(0,01)
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	2,750	15/06/2027	120 300	(1 452)	(0,01)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance		Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	2,750 %	21/09/2027	SGD	172 226	$ (1 025)	(0,01)
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	3,000	15/06/2027		45 600	(179)	0,00
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/12/2027		25 280	(113)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2029	$	145 400	(12 495)	(0,11)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/12/2028		58 224	(7 790)	(0,07)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,430	31/03/2024		256 050	(12 537)	(0,11)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,488	15/08/2031		25 600	(4 095)	(0,04)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,618	09/02/2029		21 600	(2 394)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,695	15/11/2031		422 100	(60 175)	(0,53)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024		610 261	103	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2025		6 500	43	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027		1 265 781	38 297	0,34
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2029		78 470	3 749	0,03
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032		375 550	(829)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2052		25 150	(1 103)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,888	22/03/2029		63 800	(6 178)	(0,05)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,175	21/04/2029		61 700	(5 008)	(0,04)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,750	30/04/2029		39 400	2 087	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,817	30/04/2029		74 000	3 627	0,03
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,818	30/04/2029		66 900	3 275	0,03
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,819	30/04/2029		65 800	3 220	0,03
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,886	15/05/2032		641 100	(37 781)	(0,33)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,965	30/11/2026		1 256 200	41 945	0,37
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029		11 300	(336)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,100	09/09/2029		31 000	(826)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,454	30/06/2029		82 000	(902)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,898	30/06/2029		66 300	957	0,01
À recevoir[4]	BBR-BBSW AUD à 3 mois	3,750	15/03/2024	AUD	1 327 300	1 245	0,01
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,235	04/03/2025	CAD	57 400	(3 283)	(0,03)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,250	16/06/2031		37 200	(548)	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2025		84 100	(3 492)	(0,03)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2030		207 300	(20 404)	(0,18)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,713	02/10/2029		81 100	(7 464)	(0,07)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,900	18/12/2029		107 300	(10 115)	(0,09)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,500	28/01/2052		14 500	(2 316)	(0,02)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	3,028	25/03/2052		21 700	(1 878)	(0,02)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,283	14/02/2027	CHF	47 000	(2 838)	(0,03)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,294	10/02/2027		19 900	(1 142)	(0,01)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,343	16/05/2027		31 300	(2 021)	(0,02)
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	16/03/2027	CNY	382 500	(779)	(0,01)
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	21/12/2027		21 700	(3)	0,00
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	21/12/2027		21 700	32	0,00
À payer	ESTRON EUR composé-OIS à 3 mois	1,000	23/11/2024	€	259 600	(2 687)	(0,02)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,000	21/09/2027	KRW	225 110 930	(4 196)	(0,04)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,000	15/06/2032		38 248 600	(1 222)	(0,01)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/06/2032		14 534 600	(278)	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	0,110	16/12/2023	NZD	600	(18)	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	0,528	17/03/2024		10 000	(364)	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,000	01/11/2023		324 700	(4 441)	(0,04)
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,000	15/12/2023		370 050	(5 428)	(0,05)
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,750	15/06/2027		102 300	(2 101)	(0,02)
À payer[4]	BBR NZD à 3 mois	4,000	14/06/2024		624 400	(4 305)	(0,04)
À payer	STIBOR SEK à 3 mois	0,500	19/06/2024	SEK	260 100	(1 618)	(0,01)
À payer	STIBOR SEK à 3 mois	1,000	19/06/2029		56 700	(884)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,250	30/03/2023	$	63 900	(737)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,400	15/01/2028		578 050	(93 042)	(0,81)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,750	15/12/2024		1 200	(82)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,249	31/08/2024		179 400	10 370	0,09
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	15/12/2026		444 500	52 798	0,46
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,298	25/08/2024		155 100	8 882	0,08
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,360	17/09/2024		53 950	2 976	0,03
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	15/12/2028		233 690	(33 821)	(0,30)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,518	20/01/2029		17 800	(2 304)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,545	20/01/2029		3 000	(383)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	20/01/2029		63 600	(7 817)	(0,07)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	26/01/2029		14 700	(1 801)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,000	15/12/2051		66 000	(24 075)	(0,21)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,250	20/06/2023	ZAR	263 900	(107)	0,00
À recevoir	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,250	17/06/2030	AUD	128 300	20 590	0,18
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,750	16/03/2027		92 600	(5 944)	(0,05)
À payer[4]	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	15/09/2032		40 100	(591)	(0,01)
À payer[4]	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	15/03/2033		34 000	(405)	0,00
À payer[4]	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,500	15/09/2032		899 000	(9 221)	(0,08)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,913	30/01/2029	CZK	158 300	(1 232)	(0,01)
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	0,054	27/05/2050	€	7 450	3 256	0,03
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,064	17/11/2052		17 650	9 405	0,08
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024		12 500	(538)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027		34 400	(3 528)	(0,03)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	11/05/2027		24 400	(2 492)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027		19 200	(1 926)	(0,02)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	30/03/2024		76 900	(1 806)	(0,02)

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance		Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000 %	13/05/2027	€	41 000	$ (3 625)	(0,03)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027		18 100	(1 599)	(0,01)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2025		74 200	(1 766)	(0,02)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028		773 100	(14 908)	(0,13)
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053		164 000	11 180	0,10
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033		1 197 800	(39 697)	(0,35)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	21/09/2037		55 870	(3 911)	(0,03)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	19/03/2027		183 870	(221)	0,00
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	15/03/2033		96 410	290	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	4,870	07/07/2025	MXN	393 200	(2 123)	(0,02)
						$ (304 917)	(2,67)
Total des Instruments financiers dérivés compensés						**$ (321 630)**	**(2,82)**

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

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

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

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

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

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

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,180 %	11/01/2024	49 700	$ 1 420	$ 5 267	0,05

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Option de vente - Obligation internationale du gouvernement français hors cote 0,750 % échéance 25/05/2052	€ 97,000	23/05/2025	26 800	$ 2 027	$ 10 947	0,09

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente - Indice iTraxx Europe 37 à 5 ans hors cote	Vente	3,000 %	15/03/2023	26 300	$ (46)	$ (5)	0,00

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150 %	01/12/2023	31 200	$ (97)	$ (22)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	01/12/2023	31 200	(97)	(236)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,310	11/01/2024	441 600	(1 425)	(7 299)	(0,07)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	19/01/2023	9 300	(40)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,500	19/01/2023	9 300	(40)	(113)	0,00
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	11/04/2023	47 000	(47)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	11/04/2023	47 000	(143)	(731)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	28/04/2023	32 900	(57)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	28/04/2023	32 900	(57)	(467)	(0,01)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 25 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,451	23/05/2025	26 800	(2 027)	(10 239)	(0,09)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,150	09/01/2023	19 200	(68)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	09/01/2023	19 200	(68)	(116)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	23/01/2023	7 000	(18)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,770	23/01/2023	7 000	(18)	(36)	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	19/01/2023	5 500	(23)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,500	19/01/2023	5 500	(23)	(67)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	12/01/2023	8 300	(26)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	12/01/2023	8 300	(26)	(28)	0,00

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,690 %	02/04/2024	33 700	$ (265)	$ (100)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,690	02/04/2024	33 700	(265)	(423)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,150	09/01/2023	12 500	(44)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	09/01/2023	12 500	(44)	(75)	0,00
DUB	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	19 700	(119)	(20)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	19 700	(119)	(270)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,790	08/04/2024	39 000	(300)	(127)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,790	08/04/2024	39 000	(300)	(459)	(0,01)
FAR	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,688	02/04/2024	14 400	(113)	(43)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,688	02/04/2024	14 400	(113)	(181)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	12 100	(74)	(12)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	12 100	(74)	(166)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	13 000	(84)	(16)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	13 000	(84)	(166)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	14 200	(100)	(20)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	14 200	(100)	(168)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	13 700	(95)	(21)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	13 700	(95)	(156)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	14 200	(98)	(22)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	14 200	(98)	(158)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	17 400	(120)	(21)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	17 400	(120)	(228)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	14 900	(102)	(16)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	14 900	(102)	(209)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	10 800	(78)	(16)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,088	03/11/2023	10 800	(78)	(129)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,910	10/11/2023	25 900	(172)	(35)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,910	10/11/2023	25 900	(172)	(341)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	38 900	(141)	(27)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	38 900	(141)	(278)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	24 600	(86)	(15)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/11/2023	24 600	(86)	(191)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	22 800	(71)	(19)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	22 800	(71)	(158)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,697	02/04/2024	6 300	(49)	(19)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,697	02/04/2024	6 300	(49)	(79)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,721	08/04/2024	15 300	(115)	(47)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,721	08/04/2024	15 300	(116)	(187)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	05/04/2023	103 300	(192)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	05/04/2023	103 300	(192)	(1 595)	(0,02)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	11/04/2023	171 700	(334)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	11/04/2023	171 700	(334)	(2 669)	(0,02)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	24/04/2023	32 200	(35)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	24/04/2023	32 200	(91)	(454)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	26/04/2023	38 500	(68)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	26/04/2023	38 500	(68)	(545)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	15/05/2023	55 200	(97)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	15/05/2023	55 200	(97)	(876)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	26 900	(315)	(69)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	26 900	(372)	(880)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,230	23/01/2023	26 200	(65)	(13)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,730	23/01/2023	26 200	(65)	(156)	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À recevoir	0,820	16/12/2024	123 600	(873)	(187)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	12/01/2023	16 400	(51)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	12/01/2023	16 400	(51)	(55)	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,993	11/10/2023	9 500	(64)	(13)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,993	11/10/2023	9 500	(64)	(129)	0,00
							$ (12 181)	$ (31 626)	(0,28)

[1] Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000) %	20/06/2023	$ 22 300	$ (544)	$ 465	$ (79)	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement chinois	(1,000)	20/06/2023	37 000	(706)	567	(139)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/06/2023	48 550	(1 225)	1 054	(171)	(0,01)
GST	Obligation internationale du gouvernement chinois	(1,000)	20/06/2023	10 700	(207)	167	(40)	0,00
HUS	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/06/2023	34 100	(851)	731	(120)	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/06/2023	11 200	(268)	229	(39)	0,00
					$ (3 801)	$ 3 213	$ (588)	(0,01)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[2]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000 %	20/06/2025	$ 11 810	$ (285)	$ 342	$ 57	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	17 350	(421)	505	84	0,00

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
CBK	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000 %	20/06/2025	$ 4 020	$ (97)	$ 116	$ 19	0,00
FBF	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	8 200	(200)	240	40	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement d'Abou Dabi	1,000	20/12/2026	7 400	217	(42)	175	0,00
					$ (786)	$ 1 161	$ 375	0,00

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

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

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS SUR DEVISES CROISÉES

Contrepartie	À recevoir	À payer	Date d'échéance	Montant notionnel de la devise reçue	Montant notionnel de la devise livrée	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
AZD	Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,290 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	04/01/2031	AUD 106 300	$ 80 086	$ 526	$ (307)	$ 219	0,00
CBK	Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,420 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	31/07/2029	105 500	72 795	(26)	142	116	0,00
GLM	Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,423 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	01/08/2029	101 200	69 828	(205)	144	(61)	0,00
MYC	Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,298 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	14/10/2030	65 900	47 343	287	(180)	107	0,00
						$ 582	$ (201)	$ 381	0,00

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance		Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,250 %	16/03/2032	MYR	34 402	$ 76	$ 395	$ 471	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	16/03/2032		1 100	0	10	10	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	4,000	21/09/2027		317 504	366	(1 202)	(836)	(0,01)
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000	21/09/2024	THB	2 127 400	(91)	(18)	(109)	0,00
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	21/12/2027		1 831 500	(265)	173	(92)	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	16/03/2032		196 200	29	(255)	(226)	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	15/06/2032		634 000	(72)	(762)	(834)	(0,01)
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,750	15/06/2032		164 740	(57)	150	93	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,750	21/09/2032		646 700	(17)	513	496	0,01
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	3,250	15/06/2032		218 700	33	364	397	0,00
BPS	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	15/06/2032		10 000	(3)	(10)	(13)	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	3,250	15/06/2032		12 700	2	21	23	0,00
CBK	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	16/03/2032	MYR	11 200	(19)	119	100	0,00
GLM	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	21/09/2032		150 400	(124)	854	730	0,01
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	15/06/2032	THB	318 300	(19)	(400)	(419)	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	3,250	15/06/2032		128 500	23	209	232	0,00
GST	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000	21/09/2024		8 147 650	(858)	441	(417)	0,00
JPM	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	21/09/2027	MYR	93 900	72	168	240	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	15/06/2032	THB	637 000	(69)	(770)	(839)	(0,01)
MBC	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	15/06/2032		176 300	(47)	(185)	(232)	0,00
SCX	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	21/09/2027	MYR	73 400	55	133	188	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	16/03/2032		29 600	(92)	357	265	0,00
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	1,750	21/09/2024	THB	1 457 000	69	40	109	0,00

Contrepartie	Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000 %	21/09/2024	THB 9 165 197	$ 421	$ (890)	$ (469)	0,00
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000	21/09/2027	68 911	3	15	18	0,00
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	21/09/2027	2 142 700	(381)	250	(131)	0,00
						$ (965)	$ (280)	$ (1 245)	(0,01)

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	NZD	208 769	$	130 258	$ 0	$ (1 787)	$ (1 787)	(0,02)
BOA	01/2023	£	2 556		3 090	15	0	15	0,00
	01/2023	HUF	1 106 517		2 825	0	(124)	(124)	0,00
	01/2023	¥	47 435 610		332 135	0	(27 668)	(27 668)	(0,24)
	01/2023	PEN	7 634		1 985	0	(14)	(14)	0,00
	01/2023	RON	121		24	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$	6 724	CHF	6 354	149	0	149	0,00
	01/2023		5 723	DKK	39 935	11	0	11	0,00
	01/2023		7 262	€	7 233	458	0	458	0,00
	01/2023		21 437	£	17 789	0	(35)	(35)	0,00
	01/2023		339	THB	11 769	1	0	1	0,00
	02/2023	¥	48 890 000	$	334 548	0	(37 901)	(37 901)	(0,33)
	02/2023	$	1 985	PEN	7 657	13	0	13	0,00
	02/2023	ZAR	7 525	$	420	0	(21)	(21)	0,00
	03/2023	MYR	461 740		102 302	0	(3 672)	(3 672)	(0,03)
	03/2023	$	8 884	ZAR	156 865	282	0	282	0,00
	05/2023	CNH	208 936	$	32 298	1 787	0	1 787	0,02
BPS	01/2023	£	6 779		7 784	0	(371)	(371)	0,00
	01/2023	HUF	6 203 065		16 229	0	(303)	(303)	0,00
	01/2023	ILS	83 155		24 259	679	0	679	0,01
	01/2023	NZD	1 837		1 169	7	0	7	0,00
	01/2023	SGD	1 889		1 401	0	(8)	(8)	0,00
	01/2023	THB	569		16	0	0	0	0,00
	01/2023	TWD	135 140		4 415	9	0	9	0,00
	01/2023	$	3 427	BRL	18 343	47	0	47	0,00
	02/2023	IDR	309 927	$	20	0	0	0	0,00
	02/2023	ILS	60 216		18 238	1 148	0	1 148	0,01
	03/2023	CNH	57 650		8 930	552	0	552	0,00
	03/2023	MYR	1 534		328	0	(24)	(24)	0,00
	03/2023	PEN	24 024		6 179	0	(79)	(79)	0,00
	03/2023	TWD	117 026		3 880	44	0	44	0,00
	03/2023	$	335	MXN	6 740	6	0	6	0,00
	03/2023		38 694	MYR	170 925	535	0	535	0,00
	03/2023	ZAR	156 865	$	8 622	0	(544)	(544)	(0,01)
	07/2023	ILS	8 989		2 820	243	0	243	0,00
BRC	01/2023	CNH	27 269		3 911	0	(35)	(35)	0,00
	01/2023	£	7 442		8 962	9	0	9	0,00
	01/2023	HUF	5 600 129		14 605	0	(320)	(320)	0,00
	01/2023	PEN	12 768		3 206	0	(135)	(135)	0,00
	01/2023	SEK	24 424		2 332	0	(13)	(13)	0,00
	01/2023	SGD	1 789		1 327	0	(8)	(8)	0,00
	01/2023	$	319	CZK	7 476	11	0	11	0,00
	01/2023		2 560	£	2 110	0	(21)	(21)	0,00
	01/2023		35 628	MYR	167 502	2 686	0	2 686	0,02
	01/2023		90 920	NOK	904 706	943	0	943	0,01
	01/2023		973	THB	33 580	0	(2)	(2)	0,00
	02/2023	TWD	1 234 069	$	40 147	0	(200)	(200)	0,00
	03/2023	¥	10 290 000		76 609	0	(2 167)	(2 167)	(0,02)
CBK	01/2023	AUD	26 342		17 855	36	(49)	(13)	0,00
	01/2023	CAD	4 511		3 334	4	0	4	0,00
	01/2023	CLP	2 481 643		2 604	0	(306)	(306)	0,00
	01/2023	DKK	47 180		6 690	0	(84)	(84)	0,00
	01/2023	NZD	2 180		1 389	10	0	10	0,00
	01/2023	PEN	16 726		4 165	0	(212)	(212)	0,00
	01/2023	SEK	1 830		176	0	0	0	0,00
	01/2023	THB	769 963		22 266	3	0	3	0,00
	01/2023	$	37 197	AUD	54 975	133	(40)	93	0,00
	01/2023		48 949	CHF	46 235	1 056	0	1 056	0,01
	01/2023		7 120	CLP	6 247 674	205	0	205	0,00
	01/2023		8 446	DKK	58 810	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023		11 890	€	11 216	85	0	85	0,00
	01/2023		42 554	¥	5 659 400	367	0	367	0,00
	01/2023		16	KRW	21 275	1	0	1	0,00
	01/2023		9 674	NOK	95 889	62	0	62	0,00
	01/2023		42 088	NZD	65 849	0	(439)	(439)	0,00
	01/2023		7 799	THB	270 689	28	0	28	0,00
	02/2023	CLP	2 496 154	$	2 791	0	(123)	(123)	0,00
	02/2023	COP	20 000 000		4 118	37	0	37	0,00
	02/2023	ILS	450 207		134 564	6 786	0	6 786	0,06
	02/2023	PEN	185 581		46 258	0	(2 239)	(2 239)	(0,02)

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	02/2023	TWD	632	$	21	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	02/2023	$	18 915	BRL	102 084	314	0	314	0,00
	03/2023	MXN	471 348	$	23 457	0	(425)	(425)	0,00
	03/2023	$	6 031	MXN	118 410	4	(42)	(38)	0,00
	04/2023	CLP	3 822 121	$	4 329	0	(86)	(86)	0,00
	04/2023	ILS	65 101		19 947	1 398	0	1 398	0,01
	05/2023	CNH	17 100		2 644	147	0	147	0,00
	05/2023	ILS	104 895		32 168	2 225	0	2 225	0,02
	05/2023	PEN	41 264		10 237	0	(476)	(476)	0,00
	05/2023	$	84 424	CNH	596 562	2 657	0	2 657	0,02
	07/2023	ILS	9 431	$	2 966	262	0	262	0,00
	11/2023		101 207		30 243	967	0	967	0,01
CLY	01/2023	HUF	4 036 207		10 319	0	(438)	(438)	0,00
DUB	01/2023	THB	116 595		3 379	8	0	8	0,00
	01/2023	TWD	510 539		16 671	25	0	25	0,00
	05/2023	CNH	6 227		963	54	0	54	0,00
GLM	01/2023	BRL	192 451		37 063	612	0	612	0,01
	01/2023	CLP	3 745 583		3 801	0	(589)	(589)	(0,01)
	01/2023	CNH	28 304		4 069	0	(27)	(27)	0,00
	01/2023	HUF	2 650 699		6 786	0	(278)	(278)	0,00
	01/2023	MYR	22 072		5 025	0	(24)	(24)	0,00
	01/2023	PEN	10 000		2 581	0	(36)	(36)	0,00
	01/2023	THB	261 000		7 488	0	(58)	(58)	0,00
	01/2023	$	17 833	MYR	78 637	165	(11)	154	0,00
	01/2023		3 298	PEN	13 255	170	0	170	0,00
	01/2023		643	PLN	3 262	100	0	100	0,00
	01/2023	ZAR	7 687	$	430	0	(21)	(21)	0,00
	02/2023	COP	108 663		24	2	0	2	0,00
	02/2023	$	36 836	BRL	192 451	0	(584)	(584)	(0,01)
	03/2023	CNH	123 686	$	19 153	1 179	0	1 179	0,01
	03/2023	MXN	462		23	0	0	0	0,00
	03/2023	$	9 730	CLP	8 864 315	578	0	578	0,01
	03/2023		15 184	MXN	312 136	614	0	614	0,01
IND	05/2023	CNH	330 343	$	51 075	2 835	0	2 835	0,02
JPM	01/2023	$	32 856	BRL	174 108	120	0	120	0,00
	01/2023		857	CNY	5 968	7	0	7	0,00
	01/2023		1 592	NZD	2 485	0	(20)	(20)	0,00
	01/2023		6 080	THB	210 822	16	0	16	0,00
	02/2023	IDR	535 360	$	34	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	TWD	130 605		4 302	35	0	35	0,00
	03/2023	IDR	24 388 806		1 558	0	(18)	(18)	0,00
	03/2023	$	35 436	CNH	251 872	1 166	0	1 166	0,01
	03/2023		1 540	CNY	10 653	9	0	9	0,00
	03/2023		445	MXN	8 850	2	0	2	0,00
	04/2023	ILS	109 354	$	32 969	1 812	0	1 812	0,02
	05/2023	$	44 851	CNH	316 296	1 337	0	1 337	0,01
MBC	01/2023	AUD	19 197	$	12 904	13	(131)	(118)	0,00
	01/2023	CAD	10 184		7 592	75	0	75	0,00
	01/2023	CHF	381		412	0	0	0	0,00
	01/2023	DKK	911 644		128 777	0	(2 120)	(2 120)	(0,02)
	01/2023	€	123 612		130 385	0	(1 597)	(1 597)	(0,01)
	01/2023	£	33 217		40 498	535	0	535	0,00
	01/2023	¥	10 035 390		73 122	6	(2 993)	(2 987)	(0,03)
	01/2023	NZD	1 441		910	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	PEN	3 232		845	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	8 533	AUD	12 668	60	0	60	0,00
	01/2023		4 612	CAD	6 229	13	(27)	(14)	0,00
	01/2023		12 596	€	11 827	32	0	32	0,00
	01/2023		1 926	£	1 574	0	(33)	(33)	0,00
	01/2023		120 433	¥	16 062 200	1 383	0	1 383	0,01
	01/2023		1 526	NOK	14 910	0	(12)	(12)	0,00
	01/2023		1 061	NZD	1 669	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023		3 380	PEN	13 625	185	0	185	0,00
	01/2023		11 400	THB	395 000	22	0	22	0,00
	02/2023	¥	67 460 000	$	476 577	0	(37 521)	(37 521)	(0,33)
	02/2023	$	2 563	MXN	52 732	127	0	127	0,00
	02/2023		844	PEN	3 232	1	0	1	0,00
	03/2023	IDR	14 802 750	$	946	0	(11)	(11)	0,00
	05/2023	CNH	350 028		52 157	1 077	0	1 077	0,01
MYI	01/2023	AUD	177 153		118 967	0	(1 199)	(1 199)	(0,01)
	01/2023	€	2 322		2 478	0	0	0	0,00
	01/2023	£	92		111	0	0	0	0,00
	01/2023	¥	41 314 724		301 356	0	(11 978)	(11 978)	(0,10)
	01/2023	MYR	46 246		10 478	0	(100)	(100)	0,00
	01/2023	NOK	4		0	0	0	0	0,00
	01/2023	SEK	2		0	0	0	0	0,00
	01/2023	SGD	52 723		39 138	0	(172)	(172)	0,00
	01/2023	THB	9 218		267	0	0	0	0,00
	01/2023	$	80	CHF	74	0	0	0	0,00
	01/2023		195	€	184	1	0	1	0,00
	01/2023		6 151	£	5 011	0	(123)	(123)	0,00
	01/2023		1	HKD	5	0	0	0	0,00
	01/2023		8 169	MYR	38 662	675	0	675	0,01

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	02/2023	TWD	241 461	$	7 920	$ 32	$ 0	$ 32	0,00
	03/2023	IDR	20 856 822		1 330	0	(18)	(18)	0,00
RBC	01/2023	AUD	2 040		1 368	0	(16)	(16)	0,00
	01/2023	CAD	4 660		3 424	0	(16)	(16)	0,00
	01/2023	SGD	1 651		1 222	0	(9)	(9)	0,00
	01/2023	$	1 105	CAD	1 483	0	(11)	(11)	0,00
	01/2023		1 223	SGD	1 657	13	0	13	0,00
	03/2023		33	MXN	654	0	0	0	0,00
	04/2023	MXN	154 230	$	7 440	0	(321)	(321)	0,00
RYL	01/2023	SGD	735		544	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	$	2 149	HUF	809 813	3	0	3	0,00
SCX	01/2023	CAD	9 199	$	6 847	58	0	58	0,00
	01/2023	CHF	1 019		1 100	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	CLP	1 809 844		1 819	0	(301)	(301)	0,00
	01/2023	€	2 251 559		2 343 535	0	(60 469)	(60 469)	(0,52)
	01/2023	¥	481 800		3 582	0	(72)	(72)	0,00
	01/2023	KRW	143 217 576		108 382	0	(5 455)	(5 455)	(0,05)
	01/2023	TWD	1 397 721		44 436	0	(1 101)	(1 101)	(0,01)
	01/2023	$	5 277	€	5 000	61	0	61	0,00
	01/2023		2 579	£	2 083	0	(73)	(73)	0,00
	01/2023		10 471	MYR	46 246	107	0	107	0,00
	01/2023		5 209	PEN	20 141	63	0	63	0,00
	01/2023		4 149	THB	144 119	18	0	18	0,00
	02/2023	IDR	563 327	$	36	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	$	514	TWD	15 822	3	0	3	0,00
	03/2023	CNH	70 401	$	10 906	675	0	675	0,01
	03/2023	MYR	322 260		69 865	0	(4 097)	(4 097)	(0,04)
	03/2023	TWD	103 032		3 423	46	0	46	0,00
SOG	01/2023	RON	1 227		241	0	(23)	(23)	0,00
	01/2023	SGD	542		399	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	$	2 445	SGD	3 308	23	0	23	0,00
SSB	01/2023		30 214	MYR	142 034	2 274	0	2 274	0,02
TOR	01/2023	AUD	9 756	$	6 585	0	(33)	(33)	0,00
	01/2023	CAD	23 385		17 396	136	0	136	0,00
	01/2023	£	763 414		917 843	0	(613)	(613)	(0,01)
	01/2023	¥	16 200 000		111 394	0	(11 676)	(11 676)	(0,10)
	01/2023	NZD	614		396	8	0	8	0,00
	01/2023	$	61 281	¥	8 079 500	0	(5)	(5)	0,00
UAG	01/2023	CZK	51 685	$	2 032	0	(250)	(250)	0,00
	01/2023	DKK	1 012 490		141 721	0	(3 656)	(3 656)	(0,03)
	01/2023	HUF	12 340 756		31 576	0	(1 308)	(1 308)	(0,01)
	01/2023	TWD	290 915		9 505	20	0	20	0,00
	01/2023	$	294	CAD	400	1	0	1	0,00
	02/2023	IDR	835 992	$	53	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	ILS	102 811		29 994	814	0	814	0,01
	02/2023	¥	23 470 000		166 992	0	(12 002)	(12 002)	(0,11)
	02/2023	TWD	228 455		7 426	0	(37)	(37)	0,00
						$ 45 828	$ (241 682)	$ (195 854)	(1,70)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CAD (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	13 532	CAD	18 297	$ 0	$ (28)	$ (28)	0,00
CBK	01/2023		12 544		16 951	0	(33)	(33)	0,00
MBC	01/2023	CAD	67	$	49	0	0	0	0,00
	01/2023	$	14 657	CAD	19 836	0	(17)	(17)	0,00
MYI	01/2023	CAD	317	$	234	0	0	0	0,00
						$ 0	$ (78)	$ (78)	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de distribution, Investisseurs en CHF (couverte) de capitalisation, E en CHF (couverte) de capitalisation, W en CHF (couverte) de capitalisation et W en CHF (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	316 831	CHF	299 621	$ 7 222	$ 0	$ 7 222	0,07
BRC	01/2023	CHF	131	$	141	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	64	CHF	59	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	CHF	226	$	241	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	$	528 800	CHF	499 623	11 564	0	11 564	0,10
MBC	01/2023	CHF	1 117	$	1 209	3	(1)	2	0,00
	01/2023	$	428	CHF	395	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01/2023	CHF	304	$	325	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	$	126	CHF	118	1	0	1	0,00
SCX	01/2023	CHF	1 180	$	1 275	0	(1)	(1)	0,00
UAG	01/2023	$	88	CHF	81	0	0	0	0,00
						$ 18 790	$ (11)	$ 18 779	0,17

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (exposition au risque de change) de capitalisation, Institutions en GBP (exposition au risque de change) de capitalisation, Institutions en USD (exposition au risque de change) de capitalisation, Institutions en USD (exposition au risque de change) de distribution, E en USD (exposition au risque de change) de capitalisation, E en USD (exposition au risque de change) de distribution et H Institutions en USD (exposition au risque de change) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€	5 664	$	5 973	$ 0	$ (74)	$ (74)	0,00
	01/2023	¥	144 227		1 055	0	(39)	(39)	0,00
	01/2023	$	343	CHF	325	8	0	8	0,00
	01/2023		769	IDR	11 980 923	6	0	6	0,00
	01/2023		927	¥	122 272	0	0	0	0,00
	01/2023		1 522	MXN	29 822	8	0	8	0,00
	01/2023		1 106	SGD	1 518	26	0	26	0,00
BPS	01/2023	CNY	30 303	$	4 352	0	(35)	(35)	0,00
	01/2023	KRW	433 876		330	0	(15)	(15)	0,00
	01/2023	$	673	CNY	4 690	6	0	6	0,00
	01/2023		7 201	€	6 754	11	0	11	0,00
	01/2023		9 957	£	8 259	0	(21)	(21)	0,00
	01/2023		81	SGD	111	2	0	2	0,00
BRC	01/2023	CNY	17 982	$	2 592	0	(11)	(11)	0,00
	01/2023	MYR	2 829		641	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	22 131	CNY	154 730	268	0	268	0,00
	01/2023		1 025	£	852	0	0	0	0,00
	01/2023		641	MYR	2 829	2	0	2	0,00
	01/2023		551	NOK	5 480	6	0	6	0,00
	01/2023		2 299	SEK	24 075	13	0	13	0,00
CBK	01/2023	AUD	623	$	420	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	COP	2 356 671		494	8	0	8	0,00
	01/2023	€	385		406	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	MXN	44 770		2 302	5	0	5	0,00
	01/2023	TWD	4 044		132	0	0	0	0,00
	01/2023	$	4 056	AUD	6 017	25	0	25	0,00
	01/2023		6 707	CAD	9 076	0	(9)	(9)	0,00
	01/2023		2 857	CHF	2 698	62	0	62	0,00
	01/2023		2 128	CNY	14 818	17	0	17	0,00
	01/2023		54 467	€	51 241	243	0	243	0,00
	01/2023		2 686	IDR	42 290 510	54	0	54	0,00
	01/2023		1 022	¥	139 309	34	0	34	0,00
	01/2023		53	SEK	550	0	0	0	0,00
	02/2023		492	COP	2 356 671	0	(8)	(8)	0,00
	02/2023		2 290	MXN	44 770	0	(5)	(5)	0,00
GLM	01/2023	MYR	12 836	$	2 906	0	(8)	(8)	0,00
	01/2023	$	472	COP	2 356 671	14	0	14	0,00
	01/2023		454	CZK	10 681	17	0	17	0,00
	01/2023		2 771	MYR	12 836	143	0	143	0,00
	01/2023		1 143	PLN	5 197	41	0	41	0,00
	02/2023		280	CLP	241 516	3	0	3	0,00
	02/2023		2 910	MYR	12 836	29	0	29	0,00
JPM	01/2023		27 191	£	22 518	0	(100)	(100)	0,00
MBC	01/2023	CAD	2 235	$	1 637	0	(12)	(12)	0,00
	01/2023	€	9 401		9 929	0	(108)	(108)	0,00
	01/2023	£	1 308		1 596	22	0	22	0,00
	01/2023	¥	1 189 595		8 727	0	(295)	(295)	0,00
	01/2023	$	270	AUD	402	3	0	3	0,00
	01/2023		560	CAD	751	0	(6)	(6)	0,00
	01/2023		2	CZK	50	0	0	0	0,00
	01/2023		1 594	DKK	11 336	34	0	34	0,00
	01/2023		149 978	€	143 066	2 775	0	2 775	0,03
	01/2023		1 424	£	1 168	0	(18)	(18)	0,00
	01/2023		874	ILS	2 990	0	(26)	(26)	0,00
	01/2023		48 603	¥	6 513 843	798	0	798	0,01
	01/2023		60	NOK	585	0	0	0	0,00
	01/2023		408	NZD	647	1	0	1	0,00
	02/2023		291	PEN	1 112	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	£	1 033	$	1 259	16	0	16	0,00
	01/2023	$	8 569	AUD	12 760	86	0	86	0,00
	01/2023		68 920	¥	9 448 766	2 740	0	2 740	0,02
RBC	01/2023	AUD	604	$	404	0	(6)	(6)	0,00
	01/2023	$	99	AUD	147	1	0	1	0,00
	01/2023		684	CAD	930	2	0	2	0,00
RYL	01/2023		313	¥	41 868	4	0	4	0,00
SCX	01/2023		576	AUD	856	4	0	4	0,00
	01/2023		5 259	CAD	7 065	0	(44)	(44)	0,00
	01/2023		926	CHF	860	4	0	4	0,00
	01/2023		59 837	CNY	426 733	1 939	0	1 939	0,02
	01/2023		2 665	KRW	3 431 775	62	0	62	0,00
	01/2023		881	NZD	1 414	14	0	14	0,00
SOG	01/2023		7 448	KRW	9 873 510	399	0	399	0,00
TOR	01/2023		13 361	CAD	17 960	0	(105)	(105)	0,00
UAG	01/2023	KRW	22 789	$	17	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	482	CZK	10 949	2	0	2	0,00
	01/2023		259	HUF	102 338	14	0	14	0,00
	01/2023		2	IDR	32 686	0	0	0	0,00
	01/2023		767	MXN	14 948	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		860	SEK	8 985	3	0	3	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	01/2023	$	531	SGD	716	$ 3	$ 0	$ 3	0,00
	01/2023		1 988	THB	69 976	34	0	34	0,00
						$ 10 011	$ (955)	$ 9 056	0,08

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution, G Détail en EUR (couverte) de distribution, R en EUR (couverte) de capitalisation, T en EUR (couverte) de capitalisation, W en EUR (couverte) de capitalisation et W en EUR (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	5 762	€	5 463	$ 71	$ 0	$ 71	0,00
BPS	01/2023		5 922		5 552	6	0	6	0,00
CBK	01/2023	€	13 041	$	13 767	0	(157)	(157)	0,00
	01/2023	$	1 118 837	€	1 078 571	32 759	0	32 759	0,29
JPM	01/2023		6 585		6 333	176	0	176	0,00
MBC	01/2023	€	8 342	$	8 865	0	(41)	(41)	0,00
	01/2023	$	1 258 804	€	1 200 923	23 429	0	23 429	0,20
SCX	01/2023		1 181 712		1 135 334	30 490	0	30 490	0,27
						$ 86 931	$ (198)	$ 86 733	0,76

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution, Investisseurs en GBP (couverte) de capitalisation, W en GBP (couverte) de capitalisation et W en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£	2 165	$	2 630	$ 25	$ 0	$ 25	0,00
	01/2023	$	457	£	377	0	(4)	(4)	0,00
BPS	01/2023	£	49	$	59	0	0	0	0,00
	01/2023	$	384	£	318	0	(2)	(2)	0,00
BRC	01/2023	£	565	$	681	1	0	1	0,00
	01/2023	$	163	£	135	0	0	0	0,00
JPM	01/2023		127 140		105 290	0	(467)	(467)	0,00
MBC	01/2023	£	3 793	$	4 621	58	0	58	0,00
	01/2023	$	127 540	£	106 339	518	(123)	395	0,00
MYI	01/2023		1 616		1 315	0	(34)	(34)	0,00
TOR	01/2023		126 740		105 416	85	0	85	0,00
UAG	01/2023	£	597	$	734	16	0	16	0,00
						$ 703	$ (630)	$ 73	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en NOK (couverte) de capitalisation, Investisseurs en NOK (couverte) de capitalisation et W en NOK (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BRC	01/2023	$	88 986	NOK	885 458	$ 923	$ 0	$ 923	0,01
CBK	01/2023	NOK	159	$	16	0	0	0	0,00
	01/2023	$	98 363	NOK	974 976	634	0	634	0,01
MBC	01/2023	NOK	990	$	100	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	7 582	NOK	74 221	0	(46)	(46)	(0,01)
MYI	01/2023		2 960		29 739	60	0	60	0,00
RYL	01/2023		21		209	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	NOK	2 122	$	218	3	0	3	0,00
	01/2023	$	98 364	NOK	976 035	741	0	741	0,01
TOR	01/2023		3 118		30 871	17	0	17	0,00
						$ 2 378	$ (47)	$ 2 331	0,02

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NZD (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$	32 715	NZD	52 433	$ 449	$ 0	$ 449	0,00
BPS	01/2023		20		31	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	NZD	585	$	372	2	0	2	0,00
	01/2023	$	34 969	NZD	56 010	457	0	457	0,00
JPM	01/2023	NZD	551	$	353	4	0	4	0,00
	01/2023	$	1 159	NZD	1 830	0	(2)	(2)	0,00
MBC	01/2023		2 503		3 937	0	(13)	(13)	0,00
MYI	01/2023		22		35	0	0	0	0,00
SCX	01/2023		35 102		56 356	543	0	543	0,01
						$ 1 455	$ (15)	$ 1 440	0,01

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	SEK	330	$	32	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$	652	SEK	6 653	0	(13)	(13)	0,00
BRC	01/2023		35 967		376 690	199	0	199	0,00
CBK	01/2023		3 012		31 376	2	(1)	1	0,00
MBC	01/2023	SEK	60	$	6	0	0	0	0,00
	01/2023	$	331	SEK	3 431	1	(3)	(2)	0,00
MYI	01/2023		11 682		122 876	115	0	115	0,00
SCX	01/2023		245		2 525	0	(2)	(2)	0,00
UAG	01/2023		66 936		702 240	485	0	485	0,01
						$ 802	$ (19)	$ 783	0,01

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$	51	SGD	69	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
BOA	01/2023		37 333		51 260	892	0	892	0,01
BPS	01/2023		41 315		56 642	924	0	924	0,01
BRC	01/2023		16 501		22 253	94	0	94	0,00
GLM	01/2023	SGD	937	$	686	0	(13)	(13)	(0,01)
	01/2023	$	2 580	SGD	3 526	50	0	50	0,00
MBC	01/2023		40 348		55 163	788	0	788	0,01
RBC	01/2023		70		95	0	0	0	0,00
RYL	01/2023		22 993		30 832	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01/2023		112		152	1	0	1	0,00
UAG	01/2023	SGD	265	$	194	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	$	173	SGD	234	1	0	1	0,00
						$ 2 751	$ (18)	$ 2 733	0,02

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ (90 498)**	**(0,79)**

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Ginnie Mae, TBA			
4,000 % éch. 01/01/2053	$ 7 500	$ (7 098)	(0,06)
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
2,000 % éch. 01/01/2038	198 400	(176 485)	(1,55)
2,000 % éch. 01/02/2038	1 000	(891)	(0,01)
2,000 % éch. 01/01/2053	263 150	(214 186)	(1,88)
2,000 % éch. 01/02/2053	396 000	(322 656)	(2,82)
Total des Titres vendus à découvert		**$ (721 316)**	**(6,32)**
Total des Investissements		**$ 12 766 563**	**111,79**
Autres actifs et passifs à court terme		**$ (1 346 451)**	**(11,79)**
Actif net		**$ 11 420 112**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(e) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

(f) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(g) Affilié au Fonds.

(h) Titre convertible conditionnel.

(i) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,41 %) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Citigroup, Inc.	3,290 %	17/03/2026	10/03/2022	$ 33 100	$ 31 491	0,28
Citigroup, Inc.	3,785	17/03/2033	11/03/2022	14 521	12 441	0,11
Deutsche Bank AG	3,729	14/01/2032	21/01/2021	2 005	1 470	0,01
Oracle Corp.	2,875	25/03/2031	08/11/2021	515	416	0,00
Oracle Corp.	3,950	25/03/2051	08/11/2021	109	72	0,00
				$ 50 250	$ 45 890	0,40

(j) Un titre d'une juste valeur globale de 1 610 $ (31 décembre 2021 : 1 160 107 $) et un montant en numéraire de 0 $ (31 décembre 2021 : 2 107 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 312 124 $ (31 décembre 2021 : 214 183 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 142 980 $ (31 décembre 2021 : 50 920 $ a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 11 352 524	$ 8 573	$ 11 361 097
Fonds d'investissement	322 306	798 673	0	1 120 979
Contrats de mise en pension	0	1 346 970	0	1 346 970
Instruments financiers dérivés[3]	73 477	(414 644)	0	(341 167)
Titres vendus à découvert	0	(721 316)	0	(721 316)
Totaux	**$ 395 783**	**$ 12 362 207**	**$ 8 573**	**$ 12 766 563**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 15 285 257	$ 4 396	$ 15 289 653
Fonds d'investissement	1 197 100	0	0	1 197 100
Contrats de mise en pension	0	3 378	0	3 378
Instruments financiers dérivés[3]	31 388	(30 588)	0	800
Titres vendus à découvert	0	(1 368 631)	0	(1 368 631)
Totaux	**$ 1 228 488**	**$ 13 889 416**	**$ 4 396**	**$ 15 122 300**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	En % de l'actif net
FBF	0,750 %	21/12/2022	TBD[1]	€ (1 576)	$ (1 682)	(0,01)
Total des Contrats de prise en pension					**$ (1 682)**	**(0,01)**

(1) Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ (1 118)	$ 1 920	$ 802	$ (55)	$ 370	$ 315
BOA	(61 601)	51 870	(9 731)	1 028	(1 820)	(792)
BPS	2 102	(1 850)	252	1 820	(1 950)	(130)
BRC	1 917	(1 260)	657	14 065	(8 810)	5 255
CBK	57 544	(56 500)	1 044	(8 733)	8 950	217
CIB	S/O	S/O	S/O	101	(400)	(299)
CLY	(438)	0	(438)	S/O	S/O	S/O
DUB	(789)	220	(569)	(2 755)	1 630	(1 125)
FAR	(224)	0	(224)	S/O	S/O	S/O

Tableau des investissements Fonds Global Bond Fund (suite)

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des Instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
FBF	$ 40	$ 0	$ 40	$ 91	$ 0	$ 91
GLM	(7 627)	6 700	(927)	(4 717)	6 480	1 763
GST	(287)	280	(7)	(169)	180	11
HUS	(120)	140	20	(1 480)	1 180	(300)
IND	2 835	(2 760)	75	(21)	0	(21)
JPM	3 194	(3 600)	(406)	(2 880)	350	(2 530)
MBC	(13 437)	11 460	(1 977)	S/O	S/O	S/O
MYC	(35)	350	315	(1 019)	980	(39)
MYI	(9 902)	7 130	(2 772)	15 700	(15 810)	(110)
RBC	(363)	320	(43)	(25 881)	13 290	(12 591)
RYL	2	0	2	(9 305)	9 630	325
SAL	S/O	S/O	S/O	(170)	0	(170)
SCX	(36 806)	34 940	(1 866)	23 520	(16 790)	6 730
SOG	394	(300)	94	S/O	S/O	S/O
SSB	2 274	(1 930)	344	S/O	S/O	S/O
TOR	(12 186)	12 810	624	15 709	(9 950)	5 759
UAG	(15 867)	14 840	(1 027)	(10 130)	7 260	(2 870)
WST	S/O	S/O	S/O	(54)	0	(54)

[1] L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	67,82	83,24
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	30,98	24,75
Autres valeurs mobilières	0,69	0,92
Fonds d'investissement	9,82	8,53
Contrats de mise en pension	11,79	0,02
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,62	0,27
Instruments financiers dérivés compensés	(2,82)	(0,29)
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,79)	0,03
Titres vendus à découvert	(6,32)	(9,75)
Contrats de prise en pension	(0,01)	(8,31)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Argentine	S/O	0,00
Australie	1,53	2,40
Autriche	0,07	0,08
Brésil	0,00	0,02
Canada	0,68	2,16
Îles Caïmans	2,31	3,35
Chine	0,01	6,68
République tchèque	0,00	0,00
Danemark	2,36	3,91
Finlande	0,01	0,01
France	2,98	3,07
Allemagne	2,15	2,65
Hong Kong	0,25	0,40
Hongrie	0,04	0,06
Inde	S/O	0,10
Irlande	5,70	4,63
Israël	0,46	1,47
Italie	1,23	2,46
Japon	6,06	14,06
Jersey, îles Anglo-Normandes	0,08	0,08
Kazakhstan	S/O	0,01
Koweït	S/O	0,29
Lituanie	S/O	0,07
Luxembourg	0,55	0,75
Malaisie	0,60	1,60
Île Maurice	S/O	0,04
Mexique	0,12	0,12
Multinationales	0,10	0,13
Pays-Bas	1,10	2,11
Nouvelle-Zélande	0,21	0,20
Norvège	0,27	0,14
Pérou	0,52	1,07
Pologne	0,03	S/O
Portugal	0,01	0,01
Qatar	0,13	0,66
Roumanie	0,51	0,44
Russie	S/O	0,08
Arabie saoudite	0,14	0,47
Serbie	0,22	0,27
Singapour	S/O	0,97

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Slovénie	0,19	0,38
Afrique du Sud	0,00	0,08
Corée du Sud	0,98	0,95
Espagne	0,96	3,23
Supranationales	0,20	0,11
Suède	0,00	0,00
Suisse	1,25	1,00
Thaïlande	0,29	S/O
Émirats arabes unis	0,07	0,35
Royaume-Uni	8,24	12,71
États-Unis	39,76	31,58
Instruments à court terme	17,12	1,50
Fonds d'investissement	9,82	8,53
Contrats de mise en pension	11,79	0,02
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,63	0,27
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,01)	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,03)	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection	(0,13)	0,00
Swaps de taux d'intérêt - Swaps de base	0,01	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(2,67)	(0,29)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,05	0,01
Options sur titres	0,09	0,03
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Options de change	S/O	(0,01)
Swaptions de taux d'intérêt	(0,28)	(0,17)
Options à taux d'intérêt plafonnées	S/O	0,00
Options sur titres	S/O	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	(0,01)	(0,02)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,00
Swaps sur devises croisées	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(0,01)	0,01
Swaps de rendement total sur titres	S/O	0,00
Contrats de change à terme	(1,70)	(0,38)
Contrats de change à terme couverts	1,07	0,56
Titres vendus à découvert	(6,32)	(9,75)
Autres actifs et passifs à court terme	(11,79)	(7,72)
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				
Aegon Bank NV				
0,625 % éch. 21/06/2024	€	2 800	$ 2 852	0,09
AerCap Ireland Capital DAC				
1,650 % éch. 29/10/2024	$	1 000	923	0,03
5,003 % éch. 29/09/2023		1 700	1 669	0,05
Banque de développement asiatique				
1,500 % éch. 04/05/2028	CAD	11 700	7 690	0,25
4,700 % éch. 12/03/2024	MXN	79 400	3 749	0,12
Aviation Capital Group LLC				
4,125 % éch. 01/08/2025	$	1 000	934	0,03
Banco de Sabadell S.A.				
1,125 % éch. 11/03/2027	€	2 700	2 581	0,08
Banco Santander S.A.				
1,849 % éch. 25/03/2026	$	400	354	0,01
Bank of America Corp.				
2,687 % éch. 22/04/2032		2 000	1 606	0,05
2,863 % éch. 24/08/2025	€	1 700	1 807	0,06
3,081 % éch. 22/09/2026		8 000	8 424	0,27
5,015 % éch. 22/07/2033	$	6 000	5 714	0,18
Bank of Ireland Group PLC				
1,875 % éch. 05/06/2026	€	2 400	2 381	0,08
Barclays PLC				
3,125 % éch. 17/01/2024	£	1 200	1 411	0,05
4,375 % éch. 12/01/2026	$	2 900	2 810	0,09
BlueHub Loan Fund, Inc.				
2,890 % éch. 01/01/2027		900	785	0,03
3,099 % éch. 01/01/2030		1 900	1 649	0,05
BNP Paribas S.A.				
2,219 % éch. 09/06/2026		3 600	3 308	0,11
2,871 % éch. 19/04/2032		1 600	1 255	0,04
5,198 % éch. 10/01/2030		4 150	3 952	0,13
Brookfield Finance, Inc.				
2,724 % éch. 15/04/2031		3 350	2 695	0,09
CaixaBank S.A.				
3,625 % éch. 14/09/2028 (d)(f)	€	2 200	1 659	0,05
Caja Rural de Navarra SCC				
0,875 % éch. 08/05/2025		2 000	2 011	0,06
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund				
0,900 % éch. 12/10/2029		6 000	4 678	0,15
Community Preservation Corp.				
2,867 % éch. 01/02/2030	$	3 300	2 792	0,09
Cooperatieve Rabobank UA				
3,758 % éch. 06/04/2033		1 600	1 367	0,04
Coventry Building Society				
0,010 % éch. 07/07/2028	€	600	531	0,02
CPI Property Group S.A.				
1,500 % éch. 27/01/2031		2 700	1 672	0,05
1,625 % éch. 23/04/2027		1 200	915	0,03
1,750 % éch. 14/01/2030		5 200	3 386	0,11
2,750 % éch. 22/01/2028	£	1 000	806	0,03
Credit Suisse AG				
0,250 % éch. 05/01/2026	€	900	817	0,03
0,450 % éch. 19/05/2025		1 300	1 236	0,04
6,500 % éch. 08/08/2023 (f)	$	6 100	5 921	0,19
Credit Suisse Group AG				
2,875 % éch. 02/04/2032	€	8 100	6 272	0,20
3,750 % éch. 26/03/2025	$	250	225	0,01
3,869 % éch. 12/01/2029		2 000	1 606	0,05
4,194 % éch. 01/04/2031		1 800	1 400	0,04
4,550 % éch. 17/04/2026		1 950	1 722	0,06
6,442 % éch. 11/08/2028		2 650	2 417	0,08
6,537 % éch. 12/08/2033		4 500	3 960	0,13
CTP NV				
0,500 % éch. 21/06/2025	€	3 100	2 778	0,09
0,625 % éch. 27/09/2026		1 200	987	0,03
0,875 % éch. 20/01/2026		1 300	1 131	0,04
1,500 % éch. 27/09/2031		1 100	706	0,02
Derwent London PLC				
1,875 % éch. 17/11/2031	£	5 000	4 251	0,14
Deutsche Bank AG				
0,050 % éch. 20/11/2024	€	3 300	3 306	0,11
1,375 % éch. 17/02/2032		1 800	1 402	0,04
1,625 % éch. 20/01/2027	€	2 100	$ 1 980	0,06
1,750 % éch. 19/11/2030		2 800	2 354	0,08
1,875 % éch. 23/02/2028		16 400	15 335	0,49
2,222 % éch. 18/09/2024	$	1 500	1 449	0,05
2,625 % éch. 16/12/2024	£	600	671	0,02
2,625 % éch. 12/02/2026	€	300	303	0,01
3,547 % éch. 18/09/2031	$	500	402	0,01
3,961 % éch. 26/11/2025		27 600	26 393	0,85
4,100 % éch. 13/01/2026		4 200	4 041	0,13
Digital Dutch Finco BV				
0,625 % éch. 15/07/2025	€	2 100	2 009	0,06
Digital Euro Finco LLC				
2,500 % éch. 16/01/2026		1 100	1 089	0,04
Digital Intrepid Holding BV				
0,625 % éch. 15/07/2031		3 000	2 203	0,07
DNB Boligkreditt A/S				
0,625 % éch. 19/06/2025		1 600	1 600	0,05
3,250 % éch. 28/06/2023	$	1 400	1 387	0,04
Doctors Co. An Interinsurance Exchange				
4,500 % éch. 18/01/2032		600	484	0,02
EQT AB				
2,375 % éch. 06/04/2028	€	5 000	4 699	0,15
Equinix, Inc.				
2,500 % éch. 15/05/2031	$	5 500	4 433	0,14
Erste Group Bank AG				
4,250 % éch. 15/10/2027 (d)(f)	€	600	509	0,02
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial				
3,125 % éch. 09/11/2031		8 000	8 460	0,27
Banque européenne d'investissement				
0,750 % éch. 15/07/2027	AUD	5 000	2 890	0,09
2,700 % éch. 12/01/2023		3 600	2 441	0,08
3,300 % éch. 03/02/2028		1 000	643	0,02
Goldman Sachs Group, Inc.				
0,010 % éch. 30/04/2024	€	3 200	3 376	0,11
2,650 % éch. 21/10/2032	$	7 300	5 782	0,19
2,732 % éch. 07/02/2025	€	5 200	5 538	0,18
3,000 % éch. 15/03/2024	$	5 900	5 756	0,19
HAT Holdings LLC				
3,375 % éch. 15/06/2026		10 940	9 520	0,31
HSBC Holdings PLC				
1,500 % éch. 04/12/2024	€	4 100	4 299	0,14
2,804 % éch. 24/05/2032	$	10 000	7 760	0,25
2,999 % éch. 10/03/2026		300	282	0,01
3,973 % éch. 22/05/2030		200	175	0,01
4,300 % éch. 08/03/2026		1 600	1 549	0,05
ING Groep NV				
2,125 % éch. 23/05/2026	€	8 200	8 338	0,27
Banque interaméricaine de développement				
2,500 % éch. 14/04/2027	AUD	600	377	0,01
Association internationale de développement				
1,750 % éch. 05/05/2037	€	4 000	3 580	0,12
Intesa Sanpaolo SpA				
0,750 % éch. 04/12/2024		1 400	1 419	0,05
JPMorgan Chase & Co.				
2,595 % éch. 24/02/2026	$	3 900	3 670	0,12
3,797 % éch. 23/07/2024		3 500	3 466	0,11
4,493 % éch. 24/03/2031		4 700	4 401	0,14
4,565 % éch. 14/06/2030		5 100	4 809	0,15
4,912 % éch. 25/07/2033		3 700	3 534	0,11
Jyske Realkredit A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	10 631	1 061	0,03
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		112 534	11 890	0,38
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
KBC Group NV				
0,875 % éch. 27/06/2023	€	400	424	0,01
Kilroy Realty LP				
4,750 % éch. 15/12/2028	$	1 000	909	0,03
Kookmin Bank				
0,052 % éch. 15/07/2025	€	2 100	2 054	0,07
LeasePlan Corp. NV				
0,250 % éch. 23/02/2026		5 800	5 389	0,17
Lloyds Banking Group PLC				
3,900 % éch. 12/03/2024	$	500	491	0,02
Logicor Financing SARL				
0,625 % éch. 17/11/2025	€	3 500	$ 3 199	0,10
Low Income Investment Fund				
3,386 % éch. 01/07/2026	$	750	708	0,02
3,711 % éch. 01/07/2029		1 950	1 831	0,06
MDGH GMTN RSC Ltd.				
5,500 % éch. 28/04/2033		1 400	1 482	0,05
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
0,978 % éch. 09/06/2024	€	2 200	2 273	0,07
Mizuho Financial Group, Inc.				
0,956 % éch. 16/10/2024		4 200	4 283	0,14
5,735 % éch. 11/09/2024	$	200	199	0,01
Morgan Stanley				
3,622 % éch. 01/04/2031		23 800	20 831	0,67
Nationwide Building Society				
1,700 % éch. 13/02/2023		2 000	1 994	0,06
3,766 % éch. 08/03/2024		1 500	1 492	0,05
4,302 % éch. 08/03/2029		300	271	0,01
4,363 % éch. 01/08/2024		1 100	1 086	0,03
NatWest Group PLC				
4,600 % éch. 28/06/2031 (d)(f)		1 200	862	0,03
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	42 709	4 334	0,14
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		44 298	4 634	0,15
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
0,375 % éch. 17/01/2028	€	1 400	1 207	0,04
1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	136 351	14 208	0,46
1,000 % éch. 01/10/2053		27	3	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		15 284	1 659	0,05
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050		24 558	2 600	0,08
1,500 % éch. 01/10/2053		20 194	2 202	0,07
2,000 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
Royal Bank of Canada				
0,010 % éch. 05/10/2028	€	5 600	4 933	0,16
Santander UK Group Holdings PLC				
2,896 % éch. 15/03/2032	$	1 900	1 472	0,05
3,530 % éch. 25/08/2028	€	6 100	6 096	0,20
3,625 % éch. 14/01/2026	£	300	336	0,01
3,823 % éch. 03/11/2028	$	300	269	0,01
4,750 % éch. 15/09/2025		5 000	4 769	0,15
Santander UK PLC				
3,782 % éch. 12/02/2027	£	700	841	0,03
Shinhan Bank Co. Ltd.				
0,250 % éch. 16/10/2024	€	3 100	3 107	0,10
Sirius Real Estate Ltd.				
1,125 % éch. 22/06/2026		3 300	2 756	0,09
Société Générale S.A.				
1,488 % éch. 14/12/2026	$	4 400	3 829	0,12
2,226 % éch. 21/01/2026		4 500	4 142	0,13
Standard Chartered PLC				
2,678 % éch. 29/06/2032		6 100	4 615	0,15
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
0,010 % éch. 10/09/2025	€	3 900	3 777	0,12
0,409 % éch. 07/11/2029		1 300	1 120	0,04
0,550 % éch. 06/11/2023		1 650	1 720	0,06
2,440 % éch. 18/06/2024	$	1 000	962	0,03
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
0,465 % éch. 30/05/2024	€	2 600	2 669	0,09
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
0,010 % éch. 15/10/2027		2 500	2 249	0,07
UBS AG				
5,125 % éch. 15/05/2024 (f)	$	1 100	1 088	0,03
UBS Group AG				
4,875 % éch. 12/02/2027 (d)(f)		500	425	0,01
UniCredit SpA				
2,200 % éch. 22/07/2027	€	700	678	0,02
3,127 % éch. 03/06/2032	$	4 500	3 392	0,11

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
7,500 % éch. 03/06/2026 (d)(f)	€	400	$ 416	0,01
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.				
3,150 % éch. 12/05/2025	$	700	641	0,02
Vonovia SE				
0,750 % éch. 01/09/2032	€	4 900	3 484	0,11
Workspace Group PLC				
2,250 % éch. 11/03/2028	£	2 300	2 063	0,07
ZF Finance GmbH				
2,000 % éch. 06/05/2027	€	4 400	3 856	0,12
			441 190	14,20
INDUSTRIE				
American Medical Systems Europe BV				
0,750 % éch. 08/03/2025		3 800	3 808	0,12
Broadcom, Inc.				
2,450 % éch. 15/02/2031	$	1 600	1 264	0,04
2,600 % éch. 15/02/2033		700	527	0,02
3,419 % éch. 15/04/2033		800	644	0,02
Campbell Soup Co.				
3,650 % éch. 15/03/2023		58	58	0,00
Chanel Ceres PLC				
0,500 % éch. 31/07/2026	€	3 200	3 078	0,10
Conagra Brands, Inc.				
4,300 % éch. 01/05/2024	$	600	592	0,02
Continental Wind LLC				
6,000 % éch. 28/02/2033		1 732	1 738	0,06
Dell International LLC				
6,200 % éch. 15/07/2030		2 500	2 548	0,08
Ford Motor Co.				
3,250 % éch. 12/02/2032		3 900	2 932	0,09
Lendlease Europe Finance PLC				
3,500 % éch. 02/12/2033	£	4 400	3 402	0,11
Macquarie University				
3,500 % éch. 07/09/2028	AUD	800	494	0,02
Marks & Spencer PLC				
3,750 % éch. 19/05/2026	£	7 145	7 512	0,24
Nissan Motor Co. Ltd.				
1,940 % éch. 15/09/2023	€	400	421	0,01
3,201 % éch. 17/09/2028		1 100	1 032	0,03
3,522 % éch. 17/09/2025	$	1 700	1 581	0,05
4,810 % éch. 17/09/2030		900	766	0,03
Schaeffler AG				
3,375 % éch. 12/10/2028	€	1 000	932	0,03
SEB S.A.				
1,375 % éch. 16/06/2025		3 100	3 078	0,10
VMware, Inc.				
4,650 % éch. 15/05/2027	$	1 000	969	0,03
			37 376	1,20
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
Clearway Energy Operating LLC				
3,750 % éch. 15/02/2031		3 200	2 661	0,08
4,750 % éch. 15/03/2028		1 200	1 110	0,04
Enel Finance International NV				
0,000 % éch. 17/06/2024 (a)	€	1 200	1 220	0,04
0,000 % éch. 28/05/2026 (a)		1 200	1 131	0,04
Southern Power Co.				
0,900 % éch. 15/01/2026	$	6 000	5 288	0,17
			11 410	0,37
Total des Obligations et billets privés			489 976	15,77
OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX				
Obligations Chicago Transit Authority, Illinois Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				
6,200 % éch. 01/12/2040		100	108	0,00
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Fannie Mae				
3,000 % éch. 01/03/2060		1 166	1 028	0,03
3,500 % éch. 01/01/2059		671	617	0,02
Freddie Mac				
3,500 % éch. 01/05/2048		5 647	5 242	0,17
4,000 % éch. 01/06/2048		4 027	3 867	0,12

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Ginnie Mae				
1,968 % éch. 20/04/2067	$	208	$ 206	0,01
3,000 % éch. 20/07/2046 - 20/05/2047		25	24	0,00
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)				
2,500 % éch. 01/12/2051 - 01/01/2052		48 617	41 301	1,33
3,000 % éch. 01/07/2052		8 254	7 256	0,23
3,500 % éch. 01/03/2047 - 01/12/2052		4 291	3 980	0,13
4,000 % éch. 01/07/2048		3 433	3 276	0,11
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				
2,500 % éch. 01/01/2053		13 000	11 011	0,36
3,000 % éch. 01/01/2053		164 950	144 896	4,66
3,500 % éch. 01/01/2053		51 000	46 339	1,49
4,000 % éch. 01/01/2053		93 750	87 950	2,83
4,500 % éch. 01/01/2053		149 700	144 103	4,64
6,000 % éch. 01/02/2053		21 800	22 110	0,71
			523 206	16,84
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Obligations du Trésor américain				
1,625 % éch. 15/11/2050		10 100	6 013	0,19
1,875 % éch. 15/02/2041		42 500	30 062	0,97
2,875 % éch. 15/05/2052		6 900	5 531	0,18
4,000 % éch. 15/11/2052		3 300	3 306	0,11
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (c)				
0,125 % éch. 15/07/2031		16 343	14 452	0,46
0,125 % éch. 15/01/2032		27 196	23 841	0,77
0,500 % éch. 15/01/2028		10 268	9 660	0,31
0,625 % éch. 15/07/2032		1 538	1 411	0,04
2,500 % éch. 15/01/2029		4 094	4 271	0,14
3,875 % éch. 15/04/2029		725	815	0,03
Billets du Trésor américain				
2,875 % éch. 30/04/2025		4 200	4 065	0,13
			103 427	3,33
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
American Home Mortgage Assets Trust				
2,988 % éch. 25/10/2046		83	58	0,00
4,579 % éch. 25/10/2046		1 069	577	0,02
American Home Mortgage Investment Trust				
6,787 % éch. 25/09/2035		172	77	0,00
Atlas Funding PLC				
3,894 % éch. 25/07/2058	£	1 798	2 146	0,07
Atrium Hotel Portfolio Trust				
5,498 % éch. 15/12/2036	$	5 000	4 871	0,16
Avon Finance PLC				
4,331 % éch. 20/09/2048	£	1 508	1 780	0,06
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,586 % éch. 25/11/2036 ^	$	642	344	0,01
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				
4,559 % éch. 25/06/2047		991	807	0,03
Brass PLC				
3,965 % éch. 16/11/2066	£	413	498	0,02
Canada Square Funding PLC				
4,205 % éch. 17/06/2058		2 129	2 465	0,08
4,375 % éch. 17/06/2058		3 795	4 477	0,14
4,675 % éch. 17/12/2057		1 451	1 724	0,06
Canterbury Finance PLC				
4,595 % éch. 16/05/2056		935	1 123	0,04
Charter Mortgage Funding PLC				
3,935 % éch. 16/01/2057		603	721	0,02
Chase Mortgage Finance Trust				
3,718 % éch. 25/07/2037	$	7	6	0,00
Citigroup Commercial Mortgage Trust				
3,209 % éch. 10/05/2049		2 100	1 955	0,06
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
3,849 % éch. 25/12/2035 ^		354	233	0,01
Commercial Mortgage Trust				
3,590 % éch. 10/11/2047		2 000	1 930	0,06
3,611 % éch. 10/08/2049		1 000	946	0,03
4,228 % éch. 10/05/2051		1 700	1 604	0,05
Countrywide Alternative Loan Trust				
4,629 % éch. 25/06/2036		78	70	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,809 % éch. 25/07/2046 ^	$	462	$ 385	0,01
4,869 % éch. 25/08/2047		945	759	0,02
5,500 % éch. 25/11/2034		138	132	0,00
6,250 % éch. 25/12/2036		1 088	497	0,02
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
4,929 % éch. 25/04/2046		1 851	538	0,02
4,969 % éch. 25/03/2035 ^		354	288	0,01
5,069 % éch. 25/03/2035 ^		74	65	0,00
6,000 % éch. 25/07/2036		253	144	0,01
6,000 % éch. 25/12/2036 ^		616	282	0,01
6,000 % éch. 25/03/2037		604	307	0,01
6,500 % éch. 25/11/2047		92	49	0,00
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				
4,689 % éch. 25/09/2047 ^		735	621	0,02
4,949 % éch. 25/08/2036		4 342	3 919	0,13
Dutch Property Finance BV				
2,228 % éch. 28/07/2058	€	2 420	2 550	0,08
EMF-UK PLC				
4,491 % éch. 13/03/2046	£	224	263	0,01
Eurohome UK Mortgages PLC				
3,946 % éch. 15/06/2044		27	31	0,00
EuroMASTR PLC				
3,996 % éch. 15/06/2040		47	53	0,00
Eurosail PLC				
2,165 % éch. 13/03/2045	€	70	75	0,00
Finsbury Square PLC				
4,709 % éch. 16/06/2070	£	1 749	2 099	0,07
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				
6,250 % éch. 25/11/2036 ^	$	33	12	0,00
Friary PLC				
3,993 % éch. 21/11/2067	£	152	183	0,01
Genesis Mortgage Funding PLC				
4,603 % éch. 15/09/2059		8 796	10 356	0,33
GSR Mortgage Loan Trust				
3,061 % éch. 25/11/2035	$	53	52	0,00
3,395 % éch. 25/10/2035 ^		25	23	0,00
Impac Secured Assets Trust				
4,909 % éch. 25/01/2037		496	425	0,01
IndyMac Mortgage Loan Trust				
3,837 % éch. 25/12/2034		120	114	0,00
4,729 % éch. 25/11/2036		2 551	2 412	0,08
JPMorgan Alternative Loan Trust				
4,869 % éch. 25/10/2036		245	215	0,01
JPMorgan Mortgage Trust				
3,984 % éch. 25/08/2035		120	113	0,00
6,000 % éch. 25/06/2037		777	403	0,01
Lehman XS Trust				
3,548 % éch. 25/03/2047		451	376	0,01
Ludgate Funding PLC				
3,490 % éch. 01/01/2061	£	41	47	0,00
Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust				
3,039 % éch. 25/10/2047	$	10 530	3 556	0,11
Miravet SARL				
2,758 % éch. 26/05/2065	€	1 413	1 458	0,05
Mortimer BTL PLC				
4,137 % éch. 23/06/2053	£	2 583	3 028	0,10
New Residential Mortgage Loan Trust				
3,500 % éch. 25/12/2057	$	1 001	948	0,03
Paragon Mortgages PLC				
4,290 % éch. 15/05/2045	£	175	209	0,01
Pepper Residential Securities Trust				
4,210 % éch. 16/09/2059	AUD	96	65	0,00
Polaris PLC				
4,222 % éch. 23/12/2058	£	2 665	3 127	0,10
Real Estate Asset Liquidity Trust				
3,072 % éch. 12/08/2053	CAD	201	147	0,01
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
3,483 % éch. 25/11/2037	$	252	205	0,01
4,689 % éch. 25/06/2037 ^		295	263	0,01
6,000 % éch. 25/06/2036		385	311	0,01
Residential Mortgage Securities PLC				
4,681 % éch. 20/06/2070	£	1 315	1 576	0,05
RESIMAC Bastille Trust				
5,102 % éch. 05/09/2057	$	98	98	0,00
RESIMAC Premier				
5,267 % éch. 07/02/2052		1 128	1 125	0,04

Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Ripon Mortgages PLC				
4,011 % éch. 28/08/2056	£	15 587	$ 18 402	0,59
RMAC PLC				
4,206 % éch. 12/06/2046		783	938	0,03
4,476 % éch. 12/06/2046		423	507	0,02
RMAC Securities PLC				
3,676 % éch. 12/06/2044		36	40	0,00
Sequoia Mortgage Trust				
3,194 % éch. 20/07/2037	$	206	166	0,01
Stratton Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2060	£	3 391	4 045	0,13
4,287 % éch. 12/03/2052		2 179	2 611	0,08
4,292 % éch. 25/09/2051		2 846	3 379	0,11
Structured Asset Securities Corp.				
4,669 % éch. 25/01/2036	$	141	135	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
4,679 % éch. 25/10/2036		297	260	0,01
TBW Mortgage-Backed Trust				
5,965 % éch. 25/07/2037		2 394	771	0,03
Towd Point Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2045	£	1 209	1 439	0,05
4,071 % éch. 20/10/2051		797	953	0,03
Towd Point Mortgage Trust				
5,389 % éch. 25/10/2059	$	4 310	4 268	0,14
Tower Bridge Funding PLC				
4,801 % éch. 20/09/2063	£	1 864	2 241	0,07
Trinidad Mortgage Securities PLC				
3,900 % éch. 24/01/2059		166	199	0,01
Trinity Square PLC				
3,729 % éch. 15/07/2059		1 944	2 312	0,07
Twin Bridges PLC				
4,237 % éch. 12/03/2055		3 008	3 539	0,11
Uropa Securities PLC				
3,266 % éch. 10/10/2040		278	304	0,01
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,048 % éch. 25/02/2046	$	267	235	0,01
3,266 % éch. 25/02/2037 ^		2 769	2 451	0,08
3,565 % éch. 25/09/2036		60	51	0,00
3,813 % éch. 25/10/2035		84	77	0,00
4,124 % éch. 25/09/2033		43	40	0,00
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
4,839 % éch. 25/04/2035		317	260	0,01
			121 939	3,93

TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS

Accunia European CLO DAC				
2,328 % éch. 15/07/2030	€	446	466	0,01
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
5,289 % éch. 25/12/2034	$	109	97	0,00
5,289 % éch. 25/08/2035		1 513	1 447	0,05
Adagio CLO DAC				
2,098 % éch. 15/10/2031	€	2 400	2 497	0,08
Apidos CLO				
5,253 % éch. 20/04/2031	$	5 900	5 816	0,19
Aqueduct European CLO DAC				
2,096 % éch. 20/07/2030	€	2 782	2 910	0,09
Ares European CLO DAC				
2,158 % éch. 15/10/2031		2 700	2 793	0,09
2,306 % éch. 20/04/2032		4 100	4 250	0,14
Argent Securities Trust				
4,749 % éch. 25/04/2036	$	5 106	1 700	0,05
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				
5,229 % éch. 16/01/2030		3 619	3 581	0,12
Aurium CLO DAC				
2,108 % éch. 16/01/2031	€	4 798	5 008	0,16
Bain Capital Euro CLO DAC				
2,196 % éch. 20/01/2032		2 000	2 080	0,07
Bayview Financial Asset Trust				
5,889 % éch. 25/03/2037	$	104	103	0,00
Benefit Street Partners CLO Ltd.				
5,343 % éch. 20/01/2031		2 600	2 565	0,08
Black Diamond CLO DAC				
2,778 % éch. 15/05/2032	€	4 700	4 863	0,16
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				
2,098 % éch. 15/01/2031	€	1 999	$ 2 076	0,07
2,288 % éch. 15/01/2033		2 850	2 930	0,09
BNPP AM Euro CLO DAC				
2,322 % éch. 22/07/2032		4 800	4 964	0,16
Bridgepoint CLO DAC				
2,588 % éch. 15/01/2034		3 400	3 551	0,11
Cairn CLO BV				
2,158 % éch. 15/10/2031		1 300	1 358	0,04
Cairn CLO DAC				
2,688 % éch. 20/10/2028		121	126	0,00
Carlyle Euro CLO DAC				
2,078 % éch. 15/01/2031		2 199	2 290	0,07
2,688 % éch. 15/08/2032		3 000	3 110	0,10
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.				
5,049 % éch. 17/04/2031	$	3 290	3 246	0,10
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
2,548 % éch. 15/11/2031	€	1 500	1 551	0,05
5,259 % éch. 15/01/2030	$	3 650	3 605	0,12
Catamaran CLO Ltd.				
5,425 % éch. 22/04/2030		4 278	4 217	0,14
Cedar Funding CLO Ltd.				
5,179 % éch. 17/07/2031		4 400	4 327	0,14
CIFC Funding Ltd.				
5,259 % éch. 16/11/2030		4 700	4 656	0,15
5,279 % éch. 17/10/2031		3 200	3 161	0,10
5,418 % éch. 27/04/2031		2 300	2 272	0,07
CIT Mortgage Loan Trust				
5,739 % éch. 25/10/2037		919	915	0,03
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,529 % éch. 25/07/2037		2 117	1 911	0,06
4,609 % éch. 25/09/2037 ^		194	199	0,01
4,619 % éch. 25/04/2047		5 700	5 141	0,17
4,639 % éch. 25/02/2036		622	559	0,02
5,364 % éch. 25/01/2036		2 211	2 133	0,07
CVC Cordatus Loan Fund DAC				
2,278 % éch. 27/01/2031	€	5 689	5 951	0,19
Dryden Euro CLO DAC				
2,622 % éch. 15/05/2034		1 250	1 297	0,04
Encore Credit Receivables Trust				
5,079 % éch. 25/07/2035	$	519	504	0,02
Fremont Home Loan Trust				
5,454 % éch. 25/06/2035		148	141	0,00
Gallatin CLO Ltd.				
5,328 % éch. 21/01/2028		301	299	0,01
Greenwood Park CLO Ltd.				
5,089 % éch. 15/04/2031		2 300	2 272	0,07
Griffith Park CLO DAC				
2,522 % éch. 21/11/2031	€	1 000	1 033	0,03
Grosvenor Place CLO BV				
2,325 % éch. 30/10/2029		307	324	0,01
GSAMP Trust				
4,889 % éch. 25/05/2046	$	1 400	1 313	0,04
5,109 % éch. 25/11/2035		4 500	3 574	0,12
Harvest CLO DAC				
2,018 % éch. 15/10/2031	€	3 200	3 320	0,11
2,136 % éch. 20/10/2031		1 200	1 244	0,04
2,138 % éch. 15/07/2031		3 300	3 401	0,11
2,228 % éch. 15/01/2032		4 700	4 860	0,16
2,433 % éch. 18/11/2029		70	74	0,00
2,775 % éch. 26/06/2030		3 088	3 223	0,10
Home Equity Asset Trust				
3,826 % éch. 25/02/2036	$	883	850	0,03
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
4,609 % éch. 25/04/2037		270	209	0,01
6,339 % éch. 25/03/2035		1 295	1 104	0,04
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
4,529 % éch. 25/01/2037		1 534	1 207	0,04
IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
4,069 % éch. 25/03/2035		2 070	1 971	0,06
Jubilee CLO DAC				
2,846 % éch. 15/12/2029	€	623	652	0,02
KKR CLO Ltd.				
5,259 % éch. 15/01/2031	$	3 000	2 954	0,10
Laurelin DAC				
2,176 % éch. 20/10/2031	€	1 500	$ 1 552	0,05
Long Beach Mortgage Loan Trust				
4,989 % éch. 25/01/2036	$	711	636	0,02
Madison Park Euro Funding DAC				
2,128 % éch. 15/01/2032	€	3 200	3 307	0,11
2,178 % éch. 15/07/2032		5 200	5 378	0,17
Madison Park Funding Ltd.				
0,000 % éch. 29/07/2030	$	2 000	1 971	0,06
Man GLG Euro CLO DAC				
2,188 % éch. 15/10/2032	€	5 197	5 366	0,17
Marathon CLO Ltd.				
5,545 % éch. 21/11/2027	$	10	10	0,00
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
4,709 % éch. 25/08/2036		12 561	4 496	0,14
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
4,629 % éch. 25/02/2037		646	197	0,01
5,109 % éch. 25/05/2036		252	248	0,01
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
4,459 % éch. 25/10/2036		831	399	0,01
4,489 % éch. 25/11/2036		6 033	3 012	0,10
4,639 % éch. 25/07/2036		62	53	0,00
4,989 % éch. 25/12/2034		478	417	0,01
5,064 % éch. 25/09/2035		3 300	3 092	0,10
5,349 % éch. 25/09/2034		730	694	0,02
Morgan Stanley Structured Trust				
4,689 % éch. 25/06/2037		2 900	2 614	0,08
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd.				
5,283 % éch. 20/04/2031		2 500	2 459	0,08
New Century Home Equity Loan Trust				
5,124 % éch. 25/06/2035		88	88	0,00
5,154 % éch. 25/02/2035		2 567	2 456	0,08
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				
5,019 % éch. 25/02/2036		4 400	3 978	0,13
NovaStar Mortgage Funding Trust				
4,489 % éch. 25/01/2037		2 517	897	0,03
4,929 % éch. 25/05/2036		1 700	1 584	0,05
OCP CLO Ltd.				
5,363 % éch. 20/07/2029		2 908	2 882	0,09
OCP Euro CLO DAC				
2,382 % éch. 22/09/2034	€	2 700	2 801	0,09
Option One Mortgage Loan Trust				
4,529 % éch. 25/01/2037	$	262	175	0,01
4,529 % éch. 25/03/2037		1 203	821	0,03
4,569 % éch. 25/04/2037		3 068	1 481	0,05
OZLM Ltd.				
5,089 % éch. 17/07/2029		2 698	2 667	0,09
5,665 % éch. 30/10/2030		1 335	1 316	0,04
5,674 % éch. 16/05/2030		3 677	3 622	0,12
Palmer Square CLO Ltd.				
5,179 % éch. 16/07/2031		3 500	3 456	0,11
Palmer Square European Loan Funding DAC				
2,098 % éch. 15/10/2031	€	5 672	5 870	0,19
2,108 % éch. 15/07/2031		4 283	4 450	0,14
Pepper SPARKZ Trust				
4,062 % éch. 17/08/2028	AUD	789	534	0,02
Renaissance Home Equity Loan Trust				
5,762 % éch. 25/08/2036	$	708	285	0,01
Residential Asset Securities Corp. Trust				
5,049 % éch. 25/12/2035		4 997	4 746	0,15
Saxon Asset Securities Trust				
1,799 % éch. 25/05/2035		3 177	2 965	0,10
Sculptor European CLO DAC				
2,153 % éch. 14/01/2032	€	4 900	5 089	0,16
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
5,109 % éch. 25/10/2035	$	5 600	4 877	0,16
Segovia European CLO DAC				
2,336 % éch. 20/07/2032	€	2 700	2 790	0,09
Soundview Home Loan Trust				
4,794 % éch. 25/12/2036	$	1 500	1 450	0,05
4,889 % éch. 25/11/2036		988	916	0,03
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
4,914 % éch. 25/07/2036		1 227	1 146	0,04
Terwin Mortgage Trust				
5,329 % éch. 25/11/2033		5	4	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
TIAA CLO Ltd.				
5,443 % éch. 20/07/2031	$	2 550	$ 2 508	0,08
TICP CLO Ltd.				
5,083 % éch. 20/04/2028		393	392	0,01
Toro European CLO DAC				
2,298 % éch. 15/07/2030	€	492	516	0,02
2,572 % éch. 15/02/2034		5 000	5 147	0,17
Venture CLO Ltd.				
4,959 % éch. 15/04/2027	$	137	136	0,00
5,343 % éch. 20/01/2029		3 092	3 057	0,10
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
4,734 % éch. 25/01/2037		2 902	2 778	0,09
			254 032	8,18
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Adif Alta Velocidad				
0,550 % éch. 31/10/2031	€	5 000	4 021	0,13
Auckland Council				
0,250 % éch. 17/11/2031		5 000	4 042	0,13
Obligation internationale du gouvernement australien				
0,500 % éch. 21/09/2026	AUD	5 800	3 514	0,11
1,000 % éch. 21/12/2030		2 600	1 408	0,05
1,250 % éch. 21/05/2032		1 200	638	0,02
1,750 % éch. 21/06/2051		1 400	550	0,02
4,500 % éch. 21/04/2033		6 000	4 222	0,14
Communauté autonome d'Andalousie				
0,500 % éch. 30/04/2031	€	4 000	3 295	0,11
Communauté autonome de Catalogne				
4,220 % éch. 26/04/2035		200	207	0,01
Communauté autonome de Madrid				
0,420 % éch. 30/04/2031		4 200	3 445	0,11
BNG Bank NV				
0,250 % éch. 12/01/2032		4 000	3 290	0,11
3,300 % éch. 17/07/2028	AUD	3 000	1 896	0,06
Bpifrance Financement S.A.				
2,000 % éch. 02/09/2030	€	4 200	4 079	0,13
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale				
2,875 % éch. 25/05/2027		5 000	5 259	0,17
Obligation internationale du gouvernement canadien				
2,000 % éch. 01/12/2051	CAD	3 500	1 964	0,06
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien				
1,500 % éch. 01/12/2044 (c)		532	409	0,01
Communauté Française de Belgique				
1,625 % éch. 03/05/2032	€	10 300	9 368	0,30
CPPIB Capital, Inc.				
1,500 % éch. 23/06/2028	AUD	2 300	1 304	0,04
Development Bank of Japan, Inc.				
1,875 % éch. 02/10/2024	$	3 900	3 707	0,12
2,125 % éch. 01/09/2026	€	6 000	6 117	0,20
Obligation internationale du gouvernement français				
0,750 % éch. 25/05/2052		7 700	4 340	0,14
Obligation internationale du gouvernement de Hong Kong				
2,375 % éch. 02/02/2051	$	2 400	1 512	0,05
Obligation internationale du gouvernement hongrois				
5,000 % éch. 22/02/2027	€	900	954	0,03
Obligation internationale du gouvernement israélien				
1,500 % éch. 30/11/2023	ILS	64 100	17 827	0,57
2,000 % éch. 31/03/2027		7 800	2 066	0,07
3,800 % éch. 13/05/2060	$	1 700	1 337	0,04
Obligation internationale du gouvernement italien				
6,875 % éch. 27/09/2023		2 100	2 115	0,07
Japan Finance Organization for Municipalities				
0,010 % éch. 02/02/2028	€	3 600	3 233	0,10
3,000 % éch. 12/03/2024	$	300	293	0,01
3,375 % éch. 27/09/2023		200	198	0,01
Obligation internationale du gouvernement japonais				
0,100 % éch. 01/03/2023	¥	613 000	4 647	0,15
0,100 % éch. 10/03/2028 (c)		785 910	6 162	0,20
0,200 % éch. 20/09/2032		750 000	5 573	0,18
0,200 % éch. 20/06/2036		170 000	1 175	0,04
0,500 % éch. 20/09/2046		477 000	2 947	0,09
0,500 % éch. 20/03/2049		2 380 000	14 127	0,45
0,700 % éch. 20/12/2048		342 000	2 148	0,07
0,700 % éch. 20/06/2051	¥	1 502 000	$ 9 148	0,29
1,200 % éch. 20/09/2035		168 000	1 329	0,04
1,300 % éch. 20/06/2052		620 000	4 421	0,14
1,400 % éch. 20/09/2052		260 000	1 889	0,06
Kommunalbanken A/S				
1,900 % éch. 19/01/2027	AUD	800	491	0,02
Korea Housing Finance Corp.				
0,010 % éch. 29/06/2026	€	1 300	1 224	0,04
Obligation internationale du gouvernement malaisien				
3,480 % éch. 15/03/2023	MYR	59 900	13 612	0,44
3,757 % éch. 20/04/2023		2 700	614	0,02
Émission d'investissement du gouvernement malaisien				
3,151 % éch. 15/05/2023		3 800	863	0,03
Obligation internationale du gouvernement mexicain				
5,000 % éch. 27/04/2051	$	500	408	0,01
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap				
0,875 % éch. 21/03/2046	€	3 800	2 316	0,07
Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais				
1,500 % éch. 15/05/2031	NZD	1 500	755	0,02
Ontario Teachers' Finance Trust				
0,900 % éch. 20/05/2041	€	1 400	964	0,03
1,850 % éch. 03/05/2032		4 000	3 677	0,12
Obligation internationale du gouvernement péruvien				
2,780 % éch. 01/12/2060	$	1 500	880	0,03
5,350 % éch. 12/08/2040	PEN	1 100	216	0,01
5,400 % éch. 12/08/2034		1 900	400	0,01
5,940 % éch. 12/02/2029		11 800	2 840	0,09
6,150 % éch. 12/08/2032		2 100	485	0,02
6,350 % éch. 12/08/2028		21 400	5 339	0,17
Obligation internationale du gouvernement polonais				
5,500 % éch. 16/11/2027	$	600	618	0,02
Province de l'Ontario				
1,550 % éch. 01/11/2029	CAD	11 600	7 354	0,24
Province du Québec				
2,450 % éch. 01/03/2023		2 000	1 472	0,05
Région d'Île de France				
2,230 % éch. 19/07/2032	€	6 000	5 735	0,18
Région Wallonne Belgique				
1,375 % éch. 06/04/2032		6 000	5 301	0,17
République d'Allemagne				
0,000 % éch. 15/08/2031 (a)		53 800	46 374	1,49
Obligation internationale du gouvernement roumain				
1,375 % éch. 02/12/2029		1 170	911	0,03
2,000 % éch. 28/01/2032		200	143	0,00
2,000 % éch. 14/04/2033		400	275	0,01
2,124 % éch. 16/07/2031		100	74	0,00
2,125 % éch. 07/03/2028		14 200	12 686	0,41
2,625 % éch. 02/12/2040		500	299	0,01
2,750 % éch. 14/04/2041		600	361	0,01
2,875 % éch. 13/04/2042		2 000	1 200	0,04
3,750 % éch. 07/02/2034		2 100	1 678	0,05
6,625 % éch. 27/09/2029		4 000	4 298	0,14
Obligation internationale du gouvernement serbe				
1,000 % éch. 23/09/2028		6 500	5 003	0,16
Société Du Grand Paris EPIC				
0,700 % éch. 15/10/2060		4 400	1 769	0,06
Société Nationale SNCF S.A.				
3,125 % éch. 02/11/2027		5 000	5 253	0,17
Obligation internationale du gouvernement espagnol				
1,000 % éch. 30/07/2042		3 200	2 079	0,07
1,450 % éch. 31/10/2071		500	245	0,01
3,450 % éch. 30/07/2066		9 600	9 062	0,29
Svensk Exportkredit AB				
2,000 % éch. 30/06/2027		5 500	5 552	0,18
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais				
3,390 % éch. 17/06/2037	THB	71 869	2 162	0,07
3,450 % éch. 17/06/2043		177 900	5 215	0,17
Gouvernement de la métropole de Tokyo				
2,625 % éch. 29/05/2024	$	400	386	0,01
Bon du Trésor britannique				
1,250 % éch. 31/07/2051	£	7 100	4 619	0,15
1,500 % éch. 31/07/2053		7 500	5 178	0,17
			320 562	10,32

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
TITRES PRIVILÉGIÉS			
Nationwide Building Society			
10,250 %	750	$ 113	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BILLETS DE TRÉSORERIE				
Bank of Nova Scotia				
4,310 % éch. 31/01/2023	CAD	12 000	8 821	0,28
Canadian Imperial Bank of Commerce				
4,291 % éch. 01/02/2023		7 566	5 562	0,18
4,301 % éch. 31/01/2023		14 800	10 880	0,35
Royal Bank of Canada				
4,447 % éch. 26/01/2023		4 200	3 089	0,10
Toronto-Dominion Bank				
4,200 % éch. 17/01/2023		16 950	12 480	0,40
			40 832	1,31
BILLETS À COURT TERME				
Federal Home Loan Bank				
4,320 % éch. 06/01/2023	$	18 700	18 700	0,60
4,340 % éch. 10/02/2023		22 400	22 401	0,72
4,345 % éch. 23/02/2023		22 200	22 201	0,72
			63 302	2,04
BONS DU TRÉSOR HONGROIS				
18,250 % éch. 03/01/2023 (a)(b)	HUF	9 089 000	24 223	0,78
BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN				
0,017 % éch. 04/01/2023 (a)(b)	ILS	28 700	8 130	0,26
0,532 % éch. 08/02/2023 (a)(b)		138 614	39 141	1,26
0,860 % éch. 03/05/2023 (a)(b)		21 800	6 106	0,20
1,159 % éch. 02/03/2023 (a)(b)		18 500	5 212	0,17
1,755 % éch. 05/07/2023 (a)(b)		25 100	6 982	0,22
			65 571	2,11
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS				
(0,262) % éch. 11/01/2023 (a)(b)	¥	860 100	6 519	0,21
(0,251) % éch. 11/01/2023 (a)(b)		367 900	2 788	0,09
(0,249) % éch. 11/01/2023 (a)(b)		18 000	136	0,00
(0,242) % éch. 23/01/2023 (a)(b)		144 000	1 091	0,04
(0,235) % éch. 11/01/2023 (a)(b)		2 052 000	15 552	0,50
(0,211) % éch. 06/01/2023 (a)(b)		1 986 000	15 052	0,49
(0,209) % éch. 06/01/2023 (a)(b)		8 171 000	61 928	1,99
(0,203) % éch. 16/01/2023 (a)(b)		4 824 000	36 563	1,18
(0,191) % éch. 06/01/2023 (a)(b)		4 053 000	30 718	0,99
(0,190) % éch. 16/01/2023 (a)(b)		2 116 000	16 038	0,52
(0,182) % éch. 20/03/2023 (a)(b)		5 219 000	39 569	1,27
(0,181) % éch. 13/03/2023 (a)(b)		1 415 000	10 728	0,35
(0,175) % éch. 11/01/2023 (a)(b)		3 290 000	24 936	0,80
(0,175) % éch. 20/03/2023 (a)(b)		220 000	1 668	0,05
(0,171) % éch. 20/03/2023 (a)(b)		3 441 000	26 089	0,84
(0,166) % éch. 13/03/2023 (a)(b)		3 495 000	26 497	0,85
(0,160) % éch. 23/01/2023 (a)(b)		2 477 000	18 775	0,60
(0,160) % éch. 30/01/2023 (a)(b)		1 618 900	12 271	0,40

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
(0,151) % éch. 23/01/2023 (a)(b)	¥	1 483 000	$ 11 241	0,36
(0,149) % éch. 30/01/2023 (a)(b)		741 100	5 617	0,18
(0,146) % éch. 06/02/2023 (a)(b)		12 949 000	98 156	3,16
(0,142) % éch. 06/03/2023 (a)(b)		3 677 000	27 876	0,90
(0,138) % éch. 06/02/2023 (a)(b)		741 000	5 617	0,18
(0,131) % éch. 06/03/2023 (a)(b)		1 348 000	10 219	0,33
(0,129) % éch. 13/02/2023 (a)(b)		5 707 300	43 264	1,39
(0,118) % éch. 13/02/2023 (a)(b)		8 662 700	65 668	2,11
(0,117) % éch. 20/02/2023 (a)(b)		740 000	5 610	0,18
(0,111) % éch. 20/02/2023 (a)(b)		10 140 000	76 869	2,47
			697 055	22,43

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
4,386 % éch. 30/03/2023 (a)(b)	$	2 200	$ 2 178	0,07
4,389 % éch. 30/03/2023 (a)(b)		209 500	207 356	6,68
			209 534	6,75
Total des Instruments à court terme			1 100 517	35,42
Total des Valeurs mobilières			**$ 2 913 880**	**93,79**
ACTIONS				
FONDS D'INVESTISSEMENT				
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF				
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Global Investment Grade Credit ESG Fund (e)		580 000	5 649	0,18
Total des Fonds d'investissement			**$ 5 649**	**0,18**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BPS	4,200 %	03/01/2023	04/01/2023	$ 275 900	Billets du Trésor américain 2,500 % échéance 31/05/2024	$ (281 796)	$ 275 900	$ 275 932	8,88
BRC	4,310	03/01/2023	04/01/2023	313 900	Obligations du Trésor américain 3,750 % - 4,750 % échéance 15/02/2041 - 15/08/2041	(320 650)	313 900	313 938	10,11
FICC	1,900	30/12/2022	03/01/2023	8 047	Billets du Trésor américain 0,125 % échéance 15/05/2023	(8 208)	8 047	8 048	0,26
	4,280	30/12/2022	03/01/2023	560 000	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % échéance 15/01/2027	(36 147)	560 000	560 266	18,03
					Billets du Trésor américain 0,250 % - 4,125 % échéance 31/10/2025 - 30/09/2027	(535 053)			
Total des Contrats de mise en pension						**$ (1 181 854)**	**$ 1 157 847**	**$ 1 158 184**	**37,28**

[1] Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2024	3 030	$ 1 239	0,04
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Long	09/2023	1 703	(1 020)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Long	09/2024	1 515	(517)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans mars	Court	03/2023	73	67	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars	Long	03/2023	528	(2 322)	(0,07)
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	32	26	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars	Court	03/2023	102	162	0,01
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Court	03/2023	833	3 224	0,10
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	Court	03/2023	794	1 591	0,05
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	286	2 462	0,08
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	Court	03/2023	15	409	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars	Court	03/2023	308	2 986	0,10
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Long	03/2023	5	(103)	0,00
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	32	(164)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Long	03/2023	104	(1)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	2 808	(662)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	558	(484)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Long	03/2023	8	(7)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Long	03/2023	232	(834)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	1 597	1 457	0,05
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Court	03/2023	289	1 937	0,06
				$ 9 446	0,30

[1] Option de style contrat à terme standardisé.

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Nbre de Contrats	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	$ 98,000	15/12/2023	47	$ 0	$ (4)	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	47	0	(143)	0,00
				$ 0	$ (147)	0,00
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					**$ 9 299**	**0,30**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Valeo S.A.	1,000 %	20/06/2026	€ 4 500	$ 54	0,00

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT - SWAPS DE BASE

Indice de taux variable à payer	Indice de taux variable à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,070 %	07/03/2024	$ 6 300	$ 15	0,00
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,073 %	27/04/2023	13 700	6	0,00
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,088 %	06/09/2024	46 500	20	0,00
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,102 %	04/10/2024	13 400	0	0,00
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,105 %	27/09/2024	14 200	2	0,00
				$ 43	0,00

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	0,010 %	07/02/2023	£ 52 050	$ (371)	(0,01)
À payer[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2033	79 700	(1 250)	(0,04)
À payer[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053	11 000	(235)	(0,01)
À payer[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250	15/03/2028	23 000	(791)	(0,03)
À recevoir[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,500	15/03/2025	29 700	362	0,01
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	5,750	16/03/2027	INR 3 054 760	(1 240)	(0,04)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250	21/09/2023	7 259 000	(294)	(0,01)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250	21/09/2024	23 690	(1)	0,00
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250	16/03/2032	316 000	(214)	(0,01)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,500	21/09/2024	1 939 860	95	0,00
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,500	21/09/2027	878 100	(106)	0,00
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,750	21/09/2024	3 281 700	211	0,01
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	7,000	21/09/2027	800 600	(192)	(0,01)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2028	¥ 180 000	(39)	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	17/03/2031	1 500 000	(467)	(0,01)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,035	29/11/2029	1 500 000	(399)	(0,01)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,050	15/12/2031	3 600 000	(1 156)	(0,04)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,200	19/06/2029	1 060 000	(262)	(0,01)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	19/06/2039	430 000	258	0,01
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,450	15/12/2051	730 000	(174)	(0,01)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,800	15/06/2052	360 000	265	0,01
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	2,500	21/09/2027	SGD 30 400	(552)	(0,02)
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	2,750	15/06/2027	11 500	(131)	0,00
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	2,750	21/09/2027	39 897	(246)	(0,01)
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	3,000	15/06/2027	17 600	(75)	0,00
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/12/2027	2 400	(11)	0,00
À recevoir	Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour	2,684	30/04/2025	$ 900	21	0,00
À recevoir	Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour	2,696	30/04/2025	900	21	0,00
À recevoir	Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour	2,710	30/04/2025	1 000	24	0,00
À recevoir	Taux directeur USD composé-OIS à 1 jour	2,714	30/04/2025	1 900	45	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	0,250	15/12/2023	28 500	(113)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2029	28 500	(1 725)	(0,06)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/12/2028	16 500	(822)	(0,03)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/06/2032	43 200	(3 405)	(0,11)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,430	31/03/2024	33 000	(601)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,500	15/06/2052	13 400	(1 767)	(0,06)

Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel		Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,618 %	09/02/2029	$	6 900	$ (370)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,695	15/11/2031		42 700	(3 128)	(0,10)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024		139 200	11	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027		48 120	(246)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2029		15 900	848	0,03
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032		23 100	(569)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/12/2051		3 000	(391)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2052		23 280	63	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,175	21/04/2029		10 500	(599)	(0,02)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,750	30/04/2029		10 700	655	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,817	30/04/2029		30 000	1 837	0,06
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,818	30/04/2029		15 800	968	0,03
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,819	30/04/2029		12 600	772	0,03
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,886	15/05/2032		131 900	(10 519)	(0,34)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,965	30/11/2026		270 600	10 886	0,35
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029		14 000	(416)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,100	09/09/2029		2 400	(64)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,224	30/06/2024		7 091	148	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,454	30/06/2029		17 400	(191)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,898	30/06/2029		15 600	225	0,01
À recevoir[3]	BBR-BBSW AUD à 3 mois	3,750	15/03/2024	AUD	284 400	268	0,01
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,000	16/06/2026	CAD	20 500	(134)	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,250	16/06/2031		34 000	(497)	(0,02)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2025		400	(2)	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2030		27 900	(291)	(0,01)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,500	28/01/2052		7 100	(419)	(0,01)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	3,028	25/03/2052		2 500	(137)	0,00
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,283	14/02/2027	CHF	4 200	(149)	0,00
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,294	10/02/2027		15 500	(548)	(0,02)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,343	16/05/2027		6 300	(255)	(0,01)
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	16/03/2027	CNY	83 500	(193)	(0,01)
À payer	ESTRON EUR composé-OIS à 3 mois	1,000	23/11/2024	€	67 800	(717)	(0,02)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,000	21/09/2027	KRW	78 168 800	(1 531)	(0,05)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,000	15/06/2032		16 838 200	(618)	(0,02)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	21/09/2027		11 975 840	(232)	(0,01)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/06/2032		2 242 900	(81)	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	0,528	17/03/2024	NZD	950	(3)	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,000	01/11/2023		54 500	(394)	(0,01)
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,000	15/12/2023		53 500	(454)	(0,01)
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,750	15/06/2027		35 300	(1 240)	(0,04)
À payer[3]	BBR NZD à 3 mois	4,000	14/06/2024		93 500	(958)	(0,03)
À payer	STIBOR SEK à 3 mois	1,000	19/06/2029	SEK	11 700	(45)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,250	16/06/2023	$	24 900	109	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,500	15/12/2023		39 400	(160)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,500	16/06/2028		5 300	(220)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	15/12/2028		20 200	(1 011)	(0,03)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,518	20/01/2029		12 300	(617)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,545	20/01/2029		8 200	(412)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	20/01/2029		10 300	(518)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	26/01/2029		2 300	(115)	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,000	15/12/2051		26 100	(3 383)	(0,11)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,250	20/06/2023	ZAR	11 400	(5)	0,00
À recevoir	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,250	17/06/2030	AUD	4 800	99	0,00
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,750	16/03/2027		3 000	(41)	0,00
À recevoir	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,750	16/06/2031		6 450	176	0,01
À payer[3]	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	15/09/2032		5 700	(84)	0,00
À payer[3]	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	15/03/2033		2 400	(26)	0,00
À payer[3]	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,500	15/09/2032		241 400	(2 353)	(0,08)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,913	30/01/2029	CZK	7 400	(14)	0,00
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	0,054	27/05/2050	€	600	63	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,064	17/11/2052		1 300	200	0,01
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,250	15/09/2036		1 400	(187)	(0,01)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650 %	12/04/2027	€ 6 000	$ (421)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	11/05/2027	4 300	(307)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027	3 300	(230)	(0,01)
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	30/03/2024	130 139	(2 836)	(0,09)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	7 200	(508)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	3 500	(247)	(0,01)
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2025	47 400	(985)	(0,03)
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028	163 100	(2 691)	(0,09)
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053	7 500	(677)	(0,02)
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	152 500	(4 947)	(0,16)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	21/09/2037	11 890	(1 009)	(0,03)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	21/09/2042	6 060	(1 105)	(0,04)
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	19/03/2027	50 030	(60)	0,00
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	15/03/2033	22 470	68	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	4,870	07/07/2025	MXN 20 400	(8)	0,00
					$ (48 509)	(1,56)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ (48 412)**	**(1,56)**

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,180 %	11/01/2024	8 600	$ 246	$ 911	0,03

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Option de vente - Obligation internationale du gouvernement français hors cote, 0,750 % échéance 25/05/2052	€ 97,000	23/05/2025	2 200	$ 166	$ 899	0,03

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150 %	01/12/2023	6 200	$ (19)	$ (4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	01/12/2023	6 200	(19)	(47)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,310	11/01/2024	76 400	(247)	(1 263)	(0,04)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	19/01/2023	2 600	(11)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,500	19/01/2023	2 600	(11)	(31)	0,00
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	11/04/2023	9 400	(10)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	11/04/2023	9 400	(29)	(146)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	28/04/2023	6 400	(11)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	28/04/2023	6 400	(11)	(91)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 25 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,451	23/05/2025	2 200	(166)	(841)	(0,03)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,150	09/01/2023	8 800	(31)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	09/01/2023	8 800	(31)	(53)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	23/01/2023	2 400	(6)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,770	23/01/2023	2 400	(6)	(12)	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	19/01/2023	1 600	(7)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,500	19/01/2023	1 600	(7)	(19)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	12/01/2023	3 300	(10)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	12/01/2023	3 300	(10)	(11)	0,00
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,150	09/01/2023	1 700	(6)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	09/01/2023	1 700	(6)	(10)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	5 600	(34)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	5 600	(34)	(77)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	2 500	(16)	(3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	2 500	(16)	(32)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	2 500	(18)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	2 500	(18)	(30)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	2 500	(17)	(4)	0,00

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190 %	23/10/2023	2 500	$ (17)	$ (29)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	2 600	(18)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	2 600	(18)	(29)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	3 000	(21)	(3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	3 000	(21)	(42)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	5 400	(39)	(8)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,088	03/11/2023	5 400	(39)	(64)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,910	10/11/2023	3 000	(20)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,910	10/11/2023	3 000	(20)	(39)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	5 100	(19)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	5 100	(19)	(36)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	4 600	(16)	(3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/11/2023	4 600	(16)	(36)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	5 200	(16)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	5 200	(16)	(36)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,697	02/04/2024	9 300	(73)	(28)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,697	02/04/2024	9 300	(73)	(116)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,721	08/04/2024	2 800	(21)	(9)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,721	08/04/2024	2 800	(21)	(34)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	05/04/2023	18 200	(34)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	05/04/2023	18 200	(34)	(281)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	11/04/2023	31 800	(62)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	11/04/2023	31 800	(62)	(494)	(0,02)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	24/04/2023	5 800	(6)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	24/04/2023	5 800	(16)	(82)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	26/04/2023	6 800	(12)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	26/04/2023	6 800	(12)	(96)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	15/05/2023	9 300	(16)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	15/05/2023	9 300	(16)	(148)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	8 000	(93)	(20)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	8 000	(111)	(262)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,230	23/01/2023	6 500	(16)	(3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,730	23/01/2023	6 500	(16)	(39)	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À recevoir	0,820	16/12/2024	20 100	(142)	(30)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	12/01/2023	4 100	(13)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	12/01/2023	4 100	(13)	(14)	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,993	11/10/2023	9 600	(65)	(13)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,993	11/10/2023	9 600	(65)	(130)	(0,01)
							$ (2 114)	$ (4 828)	(0,15)

(1) Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000) %	20/06/2023	$ 1 500	$ (37)	$ 32	$ (5)	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement chinois	(1,000)	20/06/2023	600	(11)	9	(2)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/06/2023	1 900	(48)	41	(7)	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement chinois	(1,000)	20/06/2023	1 300	(25)	20	(5)	0,00
HUS	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/06/2023	600	(15)	13	(2)	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/06/2023	900	(22)	19	(3)	0,00
					$ (158)	$ 134	$ (24)	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[2]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BRC	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000 %	20/06/2025	$ 1 700	$ (41)	$ 49	$ 8	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	1 100	(27)	32	5	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement d'Abou Dabi	1,000	20/12/2026	200	6	(1)	5	0,00
					$ (62)	$ 80	$ 18	0,00

(1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS SUR DEVISES CROISÉES

Contrepartie	À recevoir	À payer	Date d'échéance	Montant notionnel de la devise reçue	Montant notionnel de la devise livrée	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
AZD	Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,290 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	04/01/2031	AUD 14 600	$ 11 000	$ 73	$ (43)	$ 30	0,00
CBK	Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,420 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	31/07/2029	5 100	3 519	(1)	7	6	0,00
GLM	Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,423 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	01/08/2029	5 000	3 450	(10)	7	(3)	0,00
MYC	Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,298 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	14/10/2030	10 100	7 256	43	(27)	16	0,00
						$ 105	$ (56)	$ 49	0,00

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,250 %	16/03/2032	MYR 4 998	$ 13	$ 55	$ 68	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	21/09/2027	6 900	3	15	18	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	4,000	21/09/2027	76 338	88	(289)	(201)	(0,01)
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000	21/09/2024	THB 480 600	(21)	(4)	(25)	0,00
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	21/12/2027	540 600	(78)	51	(27)	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	16/03/2032	50 200	8	(66)	(58)	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	15/06/2032	122 300	(14)	(148)	(162)	(0,01)
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,750	15/06/2032	10 310	(4)	10	6	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,750	21/09/2032	126 900	(3)	100	97	0,01
BPS	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	15/06/2032	1 800	(1)	(1)	(2)	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	3,250	15/06/2032	47 400	7	79	86	0,00
CBK	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	16/03/2032	MYR 10 700	6	90	96	0,00
GLM	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	21/09/2032	19 500	(16)	111	95	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	15/06/2032	THB 53 000	(3)	(67)	(70)	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	3,250	15/06/2032	10 300	2	17	19	0,00
GST	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000	21/09/2024	1 437 600	(151)	78	(73)	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,500	21/09/2032	38 100	(6)	10	4	0,00
JPM	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	15/06/2032	113 200	(12)	(138)	(150)	0,00
MBC	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	15/06/2032	30 900	(8)	(33)	(41)	0,00
SCX	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	21/09/2027	MYR 33 800	25	61	86	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	16/03/2032	5 400	(17)	65	48	0,00
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000	21/09/2024	THB 1 934 802	127	(226)	(99)	0,00
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000	21/09/2027	17 364	1	4	5	0,00
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	21/09/2027	522 370	(94)	62	(32)	0,00
						$ (148)	$ (164)	$ (312)	(0,01)

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 861	$ 1 036	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	HUF 1 031 181	2 633	0	(116)	(116)	0,00
	01/2023	¥ 20 798 000	145 501	0	(12 180)	(12 180)	(0,39)
	01/2023	$ 1 453	CHF 1 375	34	0	34	0,00
	01/2023	1 801	€ 1 794	114	0	114	0,00
	01/2023	2 086	¥ 275 600	5	0	5	0,00
	01/2023	2	THB 70	0	0	0	0,00
	02/2023	¥ 14 370 000	$ 98 332	0	(11 139)	(11 139)	(0,36)
	03/2023	MYR 81 190	17 988	0	(646)	(646)	(0,02)
	03/2023	$ 2 796	ZAR 49 363	89	0	89	0,00
	05/2023	CNH 89 246	$ 13 796	762	0	762	0,02
BOM	01/2023	CAD 10 174	7 577	68	0	68	0,00
BPS	01/2023	€ 2 482	2 646	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	£ 1 681	1 930	0	(92)	(92)	0,00

Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	01/2023	HUF	2 908 783	$	7 597	$ 0	$ (156)	$ (156)	(0,01)
	01/2023	ILS	8 769		2 558	72	0	72	0,00
	01/2023	THB	118		3	0	0	0	0,00
	01/2023	TWD	273 940		8 949	18	0	18	0,00
	01/2023	$	3 418	BRL	18 580	101	0	101	0,00
	01/2023		1 251	KRW	1 627 301	42	0	42	0,00
	03/2023	ILS	18 352	$	5 422	205	0	205	0,01
	03/2023	MXN	53 325		2 646	0	(53)	(53)	0,00
	03/2023	MYR	329		70	0	(5)	(5)	0,00
	03/2023	TWD	90 306		2 996	37	0	37	0,00
	03/2023	$	656	CLP	633 054	80	0	80	0,00
	03/2023		4 834	MYR	21 355	67	0	67	0,00
	03/2023	ZAR	46 688	$	2 566	0	(162)	(162)	(0,01)
	04/2023	MYR	2 716		582	0	(43)	(43)	0,00
	05/2023		3 862		828	0	(61)	(61)	0,00
BRC	01/2023	£	1 450		1 746	2	0	2	0,00
	01/2023	HUF	2 015 548		5 256	0	(115)	(115)	0,00
	01/2023	SGD	468		347	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	601	CNH	4 193	5	0	5	0,00
	01/2023		6 094	MYR	28 830	501	0	501	0,02
	01/2023		26 103	NOK	259 736	271	0	271	0,01
	01/2023		161	THB	5 545	0	0	0	0,00
	02/2023	TWD	258 622	$	8 413	0	(42)	(42)	0,00
	03/2023	¥	8 880 000		66 112	0	(1 870)	(1 870)	(0,06)
CBK	01/2023	AUD	4 837		3 268	0	(13)	(13)	0,00
	01/2023	CAD	1 054		779	1	0	1	0,00
	01/2023	CLP	901 527		946	0	(111)	(111)	0,00
	01/2023	ILS	28 695		9 086	952	0	952	0,03
	01/2023	KRW	1 160 828		921	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	NZD	49 113		30 663	0	(401)	(401)	(0,01)
	01/2023	THB	172 521		4 989	1	0	1	0,00
	01/2023	$	3 446	AUD	5 099	19	(6)	13	0,00
	01/2023		8 513	BRL	44 680	0	(50)	(50)	0,00
	01/2023		2 750	CAD	3 713	0	(10)	(10)	0,00
	01/2023		13 154	CHF	12 425	284	0	284	0,01
	01/2023		3 259	CLP	2 809 718	33	0	33	0,00
	01/2023		2 345	€	2 235	41	0	41	0,00
	01/2023		12 649	¥	1 682 200	109	0	109	0,00
	01/2023		2 777	NOK	27 529	18	0	18	0,00
	01/2023		11 141	NZD	17 430	0	(116)	(116)	0,00
	01/2023		1 527	THB	52 995	6	0	6	0,00
	02/2023	ILS	19 427	$	5 653	139	0	139	0,00
	02/2023	PEN	40 232		10 088	0	(431)	(431)	(0,01)
	02/2023	$	2 892	BRL	15 608	48	0	48	0,00
	03/2023	PEN	6 056	$	1 567	0	(10)	(10)	0,00
	04/2023	CLP	2 849 880		3 259	0	(33)	(33)	0,00
	04/2023	PEN	5 662		1 434	0	(37)	(37)	0,00
	05/2023	CNH	9 805		1 516	84	0	84	0,00
	05/2023	ILS	21 615		6 394	224	0	224	0,01
	05/2023	$	20 110	CNH	142 033	624	0	624	0,02
	07/2023	ILS	24 718	$	7 716	629	0	629	0,02
	11/2023		63 106		18 857	603	0	603	0,02
GLM	01/2023	BRL	68 281		12 812	0	(121)	(121)	0,00
	01/2023	CAD	11 875		8 671	0	(94)	(94)	0,00
	01/2023	CLP	795 119		807	0	(125)	(125)	(0,01)
	01/2023	HUF	184 094		471	0	(19)	(19)	0,00
	01/2023	MYR	4 479		1 020	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	PEN	601		155	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	THB	54 064		1 551	0	(12)	(12)	0,00
	01/2023	$	1 553	CNH	10 813	12	0	12	0,00
	01/2023		3 723	MYR	16 406	32	(3)	29	0,00
	03/2023	CNH	18 398	$	2 849	175	0	175	0,01
	03/2023	MXN	16 018		779	0	(31)	(31)	0,00
	03/2023	$	3 772	CLP	3 436 497	224	0	224	0,01
	04/2023		12 588	BRL	68 281	123	0	123	0,00
	05/2023		3 118	PEN	12 405	101	0	101	0,00
JPM	01/2023	CAD	4 200	$	3 090	0	(10)	(10)	0,00
	01/2023	CNY	4 312		620	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	£	114 297		138 017	507	0	507	0,02
	01/2023	HUF	380 808		971	0	(44)	(44)	0,00
	01/2023	¥	144 000		1 052	0	(42)	(42)	0,00
	01/2023	$	1 824	THB	63 254	5	0	5	0,00
	02/2023	TWD	92 249	$	3 038	25	0	25	0,00
	03/2023	CNY	7 698		1 113	0	(6)	(6)	0,00
	03/2023	IDR	1 500 481		96	0	(1)	(1)	0,00
	03/2023	$	6 395	CNH	45 450	210	0	210	0,01
	05/2023		2 875		20 268	85	0	85	0,00
MBC	01/2023	AUD	3 292	$	2 201	0	(32)	(32)	0,00
	01/2023	DKK	143 842		20 319	0	(335)	(335)	(0,01)
	01/2023	€	515 810		540 787	0	(9 946)	(9 946)	(0,32)
	01/2023	£	9 598		11 703	155	0	155	0,01
	01/2023	¥	1 962 062		14 250	0	(631)	(631)	(0,02)
	01/2023	$	2 226	AUD	3 306	16	0	16	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	01/2023	$	1 296	CAD	1 740	$ 0	$ (12)	$ (12)	0,00
	01/2023		3 572	€	3 345	0	0	0	0,00
	01/2023		1 005	£	821	0	(17)	(17)	0,00
	01/2023		32 272	¥	4 289 600	261	0	261	0,01
	01/2023		1 546	NOK	15 310	9	0	9	0,00
	01/2023		3 194	THB	110 678	6	0	6	0,00
	02/2023	ILS	57 644	$	16 709	349	0	349	0,01
	02/2023	¥	13 690 000		94 831	0	(9 359)	(9 359)	(0,30)
	03/2023	IDR	910 718		58	0	(1)	(1)	0,00
	03/2023	$	926	TWD	28 124	0	(4)	(4)	0,00
	03/2023	ZAR	520	$	28	0	(2)	(2)	0,00
	05/2023	CNH	63 213		9 419	195	0	195	0,01
MYI	01/2023	€	1 115		1 187	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	£	6		7	0	0	0	0,00
	01/2023	¥	9 364 311		68 305	0	(2 715)	(2 715)	(0,09)
	01/2023	MYR	8 981		2 035	0	(19)	(19)	0,00
	01/2023	NOK	1 015		103	0	0	0	0,00
	01/2023	$	4 613	AUD	6 870	47	0	47	0,00
	01/2023		16	CHF	15	0	0	0	0,00
	01/2023		9 775	€	9 201	44	0	44	0,00
	01/2023		321	£	266	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		1 561	MYR	7 388	129	0	129	0,00
	02/2023	TWD	170 548	$	5 594	23	0	23	0,00
	03/2023	IDR	1 283 167		82	0	(1)	(1)	0,00
RBC	01/2023	CAD	752		552	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	$	53	AUD	79	1	0	1	0,00
RYL	01/2023	€	3 898	$	4 132	0	(30)	(30)	0,00
	01/2023	$	671	HUF	252 989	1	0	1	0,00
SCX	01/2023	CAD	25 678	$	18 952	56	(57)	(1)	0,00
	01/2023	CLP	1 991 250		2 001	0	(332)	(332)	(0,01)
	01/2023	¥	191 400		1 423	0	(29)	(29)	0,00
	01/2023	TWD	325 101		10 335	0	(256)	(256)	(0,01)
	01/2023	$	310	AUD	461	2	0	2	0,00
	01/2023		938	BRL	5 021	13	0	13	0,00
	01/2023		84	£	70	0	0	0	0,00
	01/2023		2 033	MYR	8 981	21	0	21	0,00
	01/2023		588	PEN	2 264	5	0	5	0,00
	01/2023		1 567	THB	54 381	5	0	5	0,00
	02/2023	CAD	7 487	$	5 468	0	(59)	(59)	0,00
	03/2023	CNH	27 028		4 187	259	0	259	0,01
	03/2023	MYR	81 461		17 582	0	(1 114)	(1 114)	(0,04)
SSB	01/2023	$	6 480	MYR	30 464	488	0	488	0,01
TOR	01/2023	CAD	27 005	$	19 961	72	(43)	29	0,00
	01/2023	¥	13 260 000		91 627	0	(9 083)	(9 083)	(0,29)
	01/2023	$	14 301	¥	1 885 500	0	(1)	(1)	0,00
UAG	01/2023	CZK	1 783	$	70	0	(9)	(9)	0,00
	01/2023	DKK	159 754		22 361	0	(577)	(577)	(0,02)
	01/2023	HUF	2 527 024		6 425	0	(308)	(308)	(0,01)
	01/2023	THB	2 065		60	0	0	0	0,00
	02/2023	ILS	60 790		17 735	481	0	481	0,01
	02/2023	¥	10 880 000		77 413	0	(5 564)	(5 564)	(0,18)
	02/2023	TWD	2 547		83	0	0	0	0,00
	03/2023	¥	10 548 307		78 035	0	(2 591)	(2 591)	(0,08)
						$ 10 425	$ (71 559)	$ (61 134)	(1,97)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Z en AUD (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$	52 241	AUD	77 551	$ 363	$ 0	$ 363	0,01
BOA	01/2023		414		612	2	0	2	0,00
CBK	01/2023		22 806		34 022	273	(2)	271	0,01
MBC	01/2023		39 509		58 783	393	(28)	365	0,01
MYI	01/2023		60 564		90 186	610	0	610	0,02
RBC	01/2023		10 934		16 311	130	0	130	0,00
TOR	01/2023		54 851		81 267	274	0	274	0,01
						$ 2 045	$ (30)	$ 2 015	0,06

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	189 831	CHF	179 532	$ 4 340	$ 0	$ 4 340	0,14
BRC	01/2023		344		319	1	0	1	0,00
CBK	01/2023		325 349		307 409	7 127	0	7 127	0,23

Tableau des investissements Fonds Global Bond ESG Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
MBC	01/2023	CHF	1 394	$	1 501	$ 1	$ (8)	$ (7)	0,00
	01/2023	$	574	CHF	536	5	0	5	0,00
MYI	01/2023		1 165		1 089	13	0	13	0,00
SCX	01/2023	CHF	29 555	$	31 829	0	(137)	(137)	(0,01)
	01/2023	$	1 511	CHF	1 398	2	0	2	0,00
UAG	01/2023	CHF	106	$	114	0	0	0	0,00
						$ 11 489	$ (145)	$ 11 344	0,36

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (exposition au risque de change) de capitalisation et Institutions en GBP (exposition au risque de change) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	5	AUD	8	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023		350	CAD	473	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		6	CHF	5	0	0	0	0,00
	01/2023		19	DKK	139	1	0	1	0,00
	01/2023		27	€	26	0	0	0	0,00
	01/2023		531	£	441	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		1 611	¥	222 137	74	0	74	0,00
	01/2023		4	SEK	41	0	0	0	0,00
	01/2023		20	SGD	27	1	0	1	0,00
	02/2023	CLP	2 857	$	3	0	0	0	0,00
	02/2023	COP	23 574		5	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	AUD	195		131	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	COP	34 442		7	0	0	0	0,00
	01/2023	€	994		1 058	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	IDR	592 099		37	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	¥	62		0	0	0	0	0,00
	01/2023	MXN	654		34	0	0	0	0,00
	01/2023	PEN	23		6	0	0	0	0,00
	01/2023	SEK	338		32	0	0	0	0,00
	01/2023	$	9	AUD	13	0	0	0	0,00
	01/2023		58	CHF	55	1	0	1	0,00
	01/2023		1 120	CNY	7 884	22	0	22	0,00
	01/2023		0	CZK	1	0	0	0	0,00
	01/2023		2 938	€	2 830	84	0	84	0,01
	01/2023		27	£	22	0	0	0	0,00
	01/2023		54	IDR	854 180	1	0	1	0,00
	01/2023		14	ILS	49	0	0	0	0,00
	01/2023		22	¥	3 012	1	0	1	0,00
	01/2023		33	MXN	654	0	0	0	0,00
	01/2023		8	NOK	80	0	0	0	0,00
	01/2023		16	NZD	26	0	0	0	0,00
	01/2023		0	SEK	0	0	0	0	0,00
	02/2023		7	COP	34 442	0	0	0	0,00
	02/2023		33	MXN	654	0	0	0	0,00
	02/2023		5	PEN	20	0	0	0	0,00
GSC	01/2023	CNY	5 631	$	807	0	(8)	(8)	0,00
	01/2023	DKK	117		17	0	0	0	0,00
	01/2023	€	2		2	0	0	0	0,00
	01/2023	KRW	128 225		101	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	MYR	321		73	0	0	0	0,00
	01/2023	$	9	CNY	63	0	0	0	0,00
	01/2023		7	COP	34 442	0	0	0	0,00
	01/2023		10	CZK	245	0	0	0	0,00
	01/2023		71	MYR	321	2	0	2	0,00
	01/2023		6	PEN	22	0	0	0	0,00
	01/2023		16	PLN	72	1	0	1	0,00
	01/2023		6	RON	30	0	0	0	0,00
	01/2023		2	SGD	2	0	0	0	0,00
	02/2023	MXN	446	$	23	0	0	0	0,00
	02/2023	MYR	131		30	0	0	0	0,00
	02/2023	PEN	13		3	0	0	0	0,00
	02/2023	$	43	MYR	190	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	CAD	346	$	254	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	CHF	42		45	0	0	0	0,00
	01/2023	CLP	4 219		5	0	0	0	0,00
	01/2023	CZK	171		8	0	0	0	0,00
	01/2023	€	994		1 058	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	£	319		384	0	0	0	0,00
	01/2023	HUF	1 623		4	0	0	0	0,00
	01/2023	ILS	34		10	0	0	0	0,00
	01/2023	¥	157 932		1 182	0	(16)	(16)	0,00
	01/2023	NOK	56		6	0	0	0	0,00
	01/2023	NZD	18		11	0	0	0	0,00
	01/2023	PLN	50		11	0	0	0	0,00
	01/2023	RON	21		5	0	0	0	0,00
	01/2023	SGD	24		18	0	0	0	0,00
	01/2023	$	177	AUD	262	1	0	1	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	01/2023	$	19	CAD	25	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023		4	CLP	4 219	1	0	1	0,00
	01/2023		36	CNY	249	0	0	0	0,00
	01/2023		4	DKK	29	0	0	0	0,00
	01/2023		15	€	14	0	0	0	0,00
	01/2023		6	HUF	2 354	0	0	0	0,00
	01/2023		0	IDR	593	0	0	0	0,00
	01/2023		0	ILS	0	0	0	0	0,00
	01/2023		13	¥	1 753	0	0	0	0,00
	01/2023		142	KRW	186 268	6	0	6	0,00
	01/2023		43	SEK	448	0	0	0	0,00
	01/2023		4	SGD	6	0	0	0	0,00
	01/2023		24	THB	862	0	0	0	0,00
	02/2023		5	CLP	4 219	0	0	0	0,00
						$ 196	$ (37)	$ 159	0,01

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€	506	$	533	$ 0	$ (7)	$ (7)	0,00
BPS	01/2023	$	888	€	833	1	0	1	0,00
CBK	01/2023	€	4 125	$	4 390	0	(15)	(15)	0,00
	01/2023	$	371 697	€	357 833	10 364	0	10 364	0,33
JPM	01/2023		8 793		8 456	235	0	235	0,01
MBC	01/2023	€	8 722	$	9 200	0	(113)	(113)	0,00
	01/2023	$	409 470	€	390 504	7 474	0	7 474	0,24
SCX	01/2023		371 702		357 114	9 592	0	9 592	0,31
						$ 27 666	$ (135)	$ 27 531	0,89

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£	6	$	7	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$	2 308	£	1 898	0	(25)	(25)	0,00
BPS	01/2023		1 023		848	0	(2)	(2)	0,00
BRC	01/2023	£	264	$	318	0	0	0	0,00
	01/2023	$	5	£	4	0	0	0	0,00
JPM	01/2023		34 369		28 462	0	(127)	(127)	0,00
MBC	01/2023	£	318	$	388	6	0	6	0,00
	01/2023	$	34 229	£	28 545	140	(27)	113	0,00
MYI	01/2023	£	59	$	72	1	0	1	0,00
	01/2023	$	62	£	50	0	(1)	(1)	0,00
TOR	01/2023		34 281		28 513	23	0	23	0,00
UAG	01/2023	£	23	$	29	1	0	1	0,00
	01/2023	$	199	£	162	0	(4)	(4)	0,00
						$ 171	$ (186)	$ (15)	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BPS	01/2023	$	472	NOK	4 673	$ 2	$ 0	$ 2	0,00
BRC	01/2023		165 068		1 642 498	1 710	(1)	1 709	0,05
CBK	01/2023		161 176		1 597 568	1 040	0	1 040	0,03
MBC	01/2023	NOK	1 094	$	110	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	20 544	NOK	201 161	7	(126)	(119)	0,00
MYI	01/2023	NOK	107 938	$	10 948	0	(12)	(12)	0,00
	01/2023	$	166	NOK	1 634	0	0	0	0,00
RYL	01/2023		23		227	0	0	0	0,00
SCX	01/2023		172 525		1 711 894	1 300	(1)	1 299	0,04
TOR	01/2023		36 872		365 088	199	0	199	0,01
						$ 4 258	$ (141)	$ 4 117	0,13

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NZD (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$	12 804	NZD	20 522	$ 176	$ 0	$ 176	0,01
CBK	01/2023		14 414		23 062	177	(5)	172	0,01
SCX	01/2023		13 600		21 835	210	0	210	0,00
						$ 563	$ (5)	$ 558	0,02

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SEK (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	SEK	48	$	5	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$	20	SEK	203	0	0	0	0,00
BRC	01/2023		14 804		155 044	82	0	82	0,00
CBK	01/2023	SEK	331	$	32	0	0	0	0,00
	01/2023	$	1 287	SEK	13 427	2	0	2	0,00
MBC	01/2023	SEK	217	$	21	0	0	0	0,00
	01/2023	$	155	SEK	1 628	1	0	1	0,00
MYI	01/2023		4 889		51 424	48	0	48	0,00
SCX	01/2023	SEK	120	$	12	0	0	0	0,00
UAG	01/2023		87		8	0	0	0	0,00
	01/2023	$	27 531	SEK	288 835	200	0	200	0,01
						$ 333	$ 0	$ 333	0,01
Total des Instruments financiers dérivés hors cote								**$ (18 379)**	**(0,59)**

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
2,000 % éch. 01/01/2038	$ 29 000	$ (25 797)	(0,83)
2,000 % éch. 01/01/2053	9 605	(7 818)	(0,25)
2,000 % éch. 01/02/2053	104 945	(85 507)	(2,75)
Total des Titres vendus à découvert		**$ (119 122)**	**(3,83)**
Total des Investissements		**$ 3 900 762**	**125,57**
Autres actifs et passifs à court terme		**$ (794 572)**	**(25,57)**
Actif net		**$ 3 106 190**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(c) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

(d) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titre convertible conditionnel.

Un montant en numéraire de 78 217 $ (31 décembre 2021 : 31 504 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 44 770 $ (31 décembre 2021 : 2 340 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 2 913 880	$ 0	$ 2 913 880
Fonds d'investissement	5 649	0	0	5 649
Contrats de mise en pension	0	1 157 847	0	1 157 847
Instruments financiers dérivés[3]	10 275	(67 767)	0	(57 492)
Titres vendus à découvert	0	(119 122)	0	(119 122)
Totaux	**$ 15 924**	**$ 3 884 838**	**$ 0**	**$ 3 900 762**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 2 374 485	$ 0	$ 2 374 485
Fonds d'investissement	6 595	0	0	6 595
Contrats de mise en pension	0	38 254	0	38 254
Instruments financiers dérivés[3]	3 264	14 315	0	17 579
Titres vendus à découvert	0	(197 580)	0	(197 580)
Totaux	**$ 9 859**	**$ 2 229 474**	**$ 0**	**$ 2 239 333**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ 569	$ (270)	$ 299	$ (4)	$ 70	$ 66
BOA	(19 412)	16 030	(3 382)	515	(560)	(45)
BOM	68	0	68	S/O	S/O	S/O
BPS	(119)	70	(49)	905	(960)	(55)
BRC	511	(350)	161	3 889	(4 120)	(231)
CBK	21 756	(21 180)	576	1 288	(1 340)	(52)
GLM	(1 813)	1 600	(213)	3 417	(3 830)	(413)
GSC	(6)	0	(6)	S/O	S/O	S/O
GST	(69)	70	1	(21)	20	(1)
HUS	(2)	0	(2)	2 165	(2 040)	125
JPM	634	(560)	74	(552)	370	(182)
MBC	(11 665)	10 830	(835)	S/O	S/O	S/O
MYC	(127)	50	(77)	(126)	(250)	(376)
MYI	(1 837)	1 310	(527)	6 997	(7 410)	(413)
RBC	128	0	128	2 371	(1 900)	471
RYL	(29)	0	(29)	(862)	750	(112)
SCX	9 488	(8 580)	908	636	(280)	356
SSB	488	(420)	68	6	0	6
TOR	(8 559)	7 570	(989)	(2 064)	1 040	(1 024)
UAG	(8 383)	7 240	(1 143)	1 135	(900)	235
WST	S/O	S/O	S/O	(9)	0	(9)

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	34,52	70,78
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	58,42	31,15
Autres valeurs mobilières	0,85	1,18
Fonds d'investissement	0,18	0,29
Contrats de mise en pension	37,28	1,66
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,30	0,20
Instruments financiers dérivés compensés	(1,56)	(0,29)
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,59)	0,85
Titres vendus à découvert	(3,83)	(8,58)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Obligations et billets privés	15,77	34,64
Obligations et billets municipaux	0,00	0,01
Agences du gouvernement américain	16,84	8,33
Obligations du Trésor américain	3,33	3,74
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	3,93	5,77
Titres adossés à des actifs	8,18	9,18
Émissions souveraines	10,32	28,50
Titres privilégiés	0,00	0,01
Instruments à court terme	35,42	12,93
Fonds d'investissement	0,18	0,29
Contrats de mise en pension	37,28	1,66
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,30	0,20
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	0,00	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt - Swaps de base	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(1,56)	(0,29)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,03	0,01
Options sur titres	0,03	0,01
Options vendues		
Options de change	S/O	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,15)	(0,12)
Options à taux d'intérêt plafonnées	S/O	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	0,00	(0,01)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,00
Swaps sur devises croisées	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(0,01)	0,01
Contrats de change à terme	(1,97)	(0,26)
Contrats de change à terme couverts	1,48	1,21
Titres vendus à découvert	(3,83)	(8,58)
Autres actifs et passifs à court terme	(25,57)	2,76
Actif net	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
AUSTRALIE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Pepper SPARKZ Trust				
4,062 % éch. 17/08/2028	AUD	542	$ 367	0,05
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Pepper Residential Securities Trust				
4,210 % éch. 16/09/2059		327	221	0,03
RESIMAC Bastille Trust				
5,102 % éch. 05/09/2057	$	211	211	0,03
			432	0,06
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement australien				
0,500 % éch. 21/09/2026	AUD	12 200	7 392	1,03
1,000 % éch. 21/12/2030		1 100	596	0,08
1,000 % éch. 21/11/2031		1 200	631	0,09
1,250 % éch. 21/05/2032		900	479	0,07
1,750 % éch. 21/06/2051		1 300	511	0,07
2,500 % éch. 21/05/2030		800	493	0,07
4,500 % éch. 21/04/2033		3 900	2 744	0,39
			12 846	1,80
Total Australie			13 645	1,91
BRÉSIL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Bradesco S.A.				
2,850 % éch. 27/01/2023	$	1 500	1 498	0,21
CANADA				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
2,750 % éch. 29/03/2028	€	1 600	1 494	0,21
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Real Estate Asset Liquidity Trust				
3,072 % éch. 12/08/2053	CAD	501	367	0,05
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement canadien				
2,000 % éch. 01/12/2051		6 800	3 816	0,53
2,750 % éch. 01/12/2048		400	267	0,04
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien				
1,500 % éch. 01/12/2044 (e)		931	715	0,10
Ontario Teachers' Finance Trust				
0,900 % éch. 20/05/2041	€	700	482	0,07
1,850 % éch. 03/05/2032		3 300	3 034	0,42
Province de l'Ontario				
0,010 % éch. 25/11/2030		2 300	1 880	0,26
			10 194	1,42
Total Canada			12 055	1,68
ÎLES CAÏMANS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Apidos CLO				
5,253 % éch. 20/04/2031	$	2 400	2 366	0,33
BlueMountain CLO Ltd.				
5,159 % éch. 15/07/2031		2 000	1 967	0,27
Catamaran CLO Ltd.				
5,425 % éch. 22/04/2030		2 587	2 550	0,36
CBAM CLO Ltd.				
5,099 % éch. 17/04/2031		2 000	1 964	0,27
LCM LP				
5,283 % éch. 20/10/2027		625	622	0,09
Marathon CLO Ltd.				
5,545 % éch. 21/11/2027		32	32	0,00
Regatta Funding Ltd.				
5,329 % éch. 17/10/2030		1 100	1 088	0,15
TIAA CLO Ltd.				
5,443 % éch. 20/07/2031		2 200	2 164	0,30
Venture CLO Ltd.				
4,959 % éch. 15/04/2027		342	341	0,05
5,293 % éch. 20/07/2030		2 498	2 441	0,34
Voya CLO Ltd.				
5,289 % éch. 15/10/2030	$	1 793	$ 1 773	0,25
			17 308	2,41
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
KSA Sukuk Ltd.				
5,268 % éch. 25/10/2028		800	832	0,12
QNB Finance Ltd.				
1,375 % éch. 26/01/2026		200	179	0,02
S.A. Global Sukuk Ltd.				
2,694 % éch. 17/06/2031		600	514	0,07
Sands China Ltd.				
5,625 % éch. 08/08/2025		500	479	0,07
5,900 % éch. 08/08/2028		900	844	0,12
Tencent Holdings Ltd.				
3,595 % éch. 19/01/2028		200	184	0,03
U.S. Capital Funding Ltd.				
5,190 % éch. 01/08/2034		174	172	0,02
			3 204	0,45
Total Îles Caïmans			20 512	2,86
CHINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Banque de développement chinoise				
4,040 % éch. 10/04/2027	CNY	1 580	238	0,03
Obligation du gouvernement chinois				
2,370 % éch. 20/01/2027		25 000	3 565	0,50
3,010 % éch. 13/05/2028		13 300	1 942	0,27
3,530 % éch. 18/10/2051		29 100	4 401	0,62
3,720 % éch. 12/04/2051		9 300	1 450	0,20
3,810 % éch. 14/09/2050		24 300	3 839	0,54
Total Chine			15 435	2,16
DANEMARK				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Jyske Realkredit A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	39 762	4 014	0,56
1,500 % éch. 01/10/2037		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		2 087	218	0,03
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
1,000 % éch. 01/10/2050		51 169	5 271	0,74
1,500 % éch. 01/10/2037		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		6 051	670	0,09
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050		41 076	4 330	0,60
1,500 % éch. 01/10/2037		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		23 308	2 474	0,35
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/10/2036		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050		13 729	1 454	0,20
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2053		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/04/2036		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/04/2047		0	0	0,00
Total Danemark			18 431	2,57
FRANCE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BNP Paribas S.A.				
1,675 % éch. 30/06/2027	$	1 300	1 133	0,16
2,159 % éch. 15/09/2029		1 300	1 062	0,15
2,591 % éch. 20/01/2028		1 200	1 057	0,15
Société Générale S.A.				
1,488 % éch. 14/12/2026		700	609	0,08
2,797 % éch. 19/01/2028		700	613	0,09
3,337 % éch. 21/01/2033		2 100	1 659	0,23
			6 133	0,86
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Agence Française de Développement				
1,125 % éch. 02/03/2037	€	2 900	$ 2 202	0,31
Obligation internationale du gouvernement français				
0,500 % éch. 25/05/2072		900	358	0,05
0,750 % éch. 25/05/2052		8 600	4 847	0,68
2,000 % éch. 25/05/2048		11 500	9 488	1,32
3,250 % éch. 25/05/2045		200	211	0,03
			17 106	2,39
Total France			23 239	3,25
ALLEMAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Deutsche Bank AG				
0,050 % éch. 20/11/2024		4 900	4 909	0,69
1,000 % éch. 19/11/2025		200	199	0,03
1,375 % éch. 03/09/2026		3 400	3 311	0,46
1,375 % éch. 17/02/2032		1 500	1 168	0,16
1,625 % éch. 20/01/2027		3 300	3 111	0,43
1,750 % éch. 19/11/2030		1 000	840	0,12
3,729 % éch. 14/01/2032 (j)	$	300	221	0,03
3,961 % éch. 26/11/2025		900	861	0,12
IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % en numéraire ou 4,375 % de rémunération en nature)				
3,625 % éch. 15/05/2025 (b)	€	1 300	1 269	0,18
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				
5,000 % éch. 19/03/2024	AUD	100	69	0,01
Landwirtschaftliche Rentenbank				
4,250 % éch. 24/01/2023		1 500	1 018	0,14
5,375 % éch. 23/04/2024	NZD	1 100	694	0,10
Total Allemagne			17 670	2,47
HONG KONG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd.				
6,307 % éch. 25/05/2023	$	600	596	0,08
HONGRIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement hongrois				
5,000 % éch. 22/02/2027	€	200	212	0,03
IRLANDE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Accunia European CLO DAC				
2,328 % éch. 15/07/2030		713	746	0,10
Armada Euro CLO DAC				
2,098 % éch. 15/07/2031		800	829	0,12
Aurium CLO DAC				
2,108 % éch. 16/01/2031		2 099	2 191	0,31
Black Diamond CLO DAC				
2,778 % éch. 15/05/2032		2 400	2 483	0,35
2,834 % éch. 03/10/2029		57	61	0,01
BNPP AM Euro CLO DAC				
2,322 % éch. 22/07/2032		2 200	2 275	0,32
Cairn CLO DAC				
2,158 % éch. 15/10/2031		850	888	0,12
2,178 % éch. 30/04/2031		1 579	1 644	0,23
Carlyle Euro CLO DAC				
2,078 % éch. 15/01/2031		1 499	1 561	0,22
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				
2,338 % éch. 16/01/2033		1 900	1 953	0,27
Dryden Euro CLO DAC				
2,038 % éch. 15/04/2033		1 200	1 243	0,17
2,622 % éch. 15/05/2034		1 200	1 245	0,17
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				
2,356 % éch. 20/01/2032		2 000	2 064	0,29
Griffith Park CLO DAC				
2,522 % éch. 21/11/2031		1 000	1 033	0,14
Harvest CLO DAC				
2,136 % éch. 20/10/2031		1 000	1 037	0,15
2,138 % éch. 15/07/2031		2 100	2 164	0,30
2,228 % éch. 15/01/2032		2 100	2 172	0,30
2,433 % éch. 18/11/2029		337	355	0,05
Jubilee CLO DAC				
1,978 % éch. 15/04/2030		1 200	1 253	0,18

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
2,028 % éch. 15/04/2031	€	800	$ 814	0,11
2,128 % éch. 12/07/2028		70	74	0,01
2,846 % éch. 15/12/2029		311	326	0,05
Laurelin DAC				
2,176 % éch. 20/10/2031		2 100	2 173	0,30
Madison Park Euro Funding DAC				
2,178 % éch. 15/07/2032		2 200	2 275	0,32
Oak Hill European Credit Partners DAC				
2,196 % éch. 20/10/2031		2 200	2 278	0,32
Palmer Square European Loan Funding DAC				
2,098 % éch. 15/10/2031		2 494	2 581	0,36
Sculptor European CLO DAC				
2,153 % éch. 14/01/2032		2 100	2 181	0,30
Segovia European CLO DAC				
2,336 % éch. 20/07/2032		2 000	2 067	0,29
Toro European CLO DAC				
2,572 % éch. 15/02/2034		2 200	2 265	0,32
			44 231	6,18
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AerCap Ireland Capital DAC				
1,150 % éch. 29/10/2023	$	600	577	0,08
1,650 % éch. 29/10/2024		500	462	0,06
1,750 % éch. 29/10/2024		500	460	0,06
Bank of Ireland Group PLC				
1,875 % éch. 05/06/2026	€	900	893	0,13
			2 392	0,33
Total Irlande			46 623	6,51
ISRAËL				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement israélien				
0,150 % éch. 31/07/2023	ILS	13 100	3 640	0,51
1,500 % éch. 30/11/2023		11 000	3 059	0,43
2,000 % éch. 31/03/2027		7 600	2 013	0,28
Total Israël			8 712	1,22
ITALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AMCO - Asset Management Co. SpA				
1,500 % éch. 17/07/2023	€	2 000	2 114	0,30
Atlantia SpA				
1,875 % éch. 12/02/2028		600	534	0,07
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
0,875 % éch. 08/10/2027		200	190	0,03
2,000 % éch. 29/01/2024		2 200	2 307	0,32
2,625 % éch. 28/04/2025		100	97	0,01
UniCredit SpA				
7,500 % éch. 03/06/2026 (f)(h)		1 000	1 041	0,15
7,830 % éch. 04/12/2023	$	2 800	2 829	0,39
			9 112	1,27
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement italien				
6,000 % éch. 04/08/2028	£	100	121	0,02
Total Italie			9 233	1,29
JAPON				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Mizuho Financial Group, Inc.				
3,922 % éch. 11/09/2024	$	1 000	984	0,14
5,735 % éch. 11/09/2024		1 500	1 496	0,21
Nissan Motor Co. Ltd.				
3,522 % éch. 17/09/2025		200	186	0,02
4,345 % éch. 17/09/2027		1 400	1 272	0,18
4,810 % éch. 17/09/2030		1 000	851	0,12
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
0,409 % éch. 07/11/2029	€	1 800	1 551	0,22
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
0,010 % éch. 15/10/2027		2 000	1 799	0,25
			8 139	1,14
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Japan Finance Organization for Municipalities				
3,375 % éch. 27/09/2023	$	1 800	1 777	0,25

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Obligation internationale du gouvernement japonais				
0,100 % éch. 01/03/2023	¥	38 000	$ 288	0,04
0,100 % éch. 10/03/2028 (e)		806 868	6 326	0,88
0,500 % éch. 20/03/2049		976 000	5 793	0,81
0,700 % éch. 20/12/2048		1 118 000	7 023	0,98
0,700 % éch. 20/09/2051		730 000	4 435	0,62
Gouvernement de la métropole de Tokyo				
0,750 % éch. 16/07/2025	$	800	721	0,10
2,625 % éch. 29/05/2024		400	387	0,05
			26 750	3,73
Total Japon			34 889	4,87
LUXEMBOURG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Aroundtown S.A.				
0,000 % éch. 16/07/2026 (c)	€	700	533	0,07
0,375 % éch. 15/04/2027		100	71	0,01
CPI Property Group S.A.				
2,750 % éch. 12/05/2026		2 100	1 765	0,25
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % éch. 19/11/2025		500	431	0,06
Logicor Financing SARL				
0,625 % éch. 17/11/2025		1 400	1 280	0,18
			4 080	0,57
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Miravet SARL				
2,758 % éch. 26/05/2065		967	998	0,14
Total Luxembourg			5 078	0,71
MALAISIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Petronas Capital Ltd.				
2,480 % éch. 28/01/2032	$	400	332	0,05
3,500 % éch. 21/04/2030		400	366	0,05
4,550 % éch. 21/04/2050		300	269	0,04
4,800 % éch. 21/04/2060		300	276	0,04
			1 243	0,18
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement malaisien				
3,480 % éch. 15/03/2023	MYR	22 800	5 181	0,72
Émission d'investissement du gouvernement malaisien				
3,151 % éch. 15/05/2023		600	136	0,02
			5 317	0,74
Total Malaisie			6 560	0,92
MEXIQUE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement mexicain				
4,000 % éch. 15/03/2115	€	400	301	0,04
MULTINATIONALES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Preferred Term Securities Ltd.				
5,138 % éch. 23/06/2035	$	855	811	0,11
PAYS-BAS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Cooperatieve Rabobank UA				
3,758 % éch. 06/04/2033		600	513	0,07
CTP NV				
0,625 % éch. 27/09/2026	€	600	493	0,07
0,875 % éch. 20/01/2026		900	783	0,11
1,500 % éch. 27/09/2031		600	385	0,05
Enel Finance International NV				
1,875 % éch. 12/07/2028	$	800	637	0,09
2,650 % éch. 10/09/2024		1 100	1 053	0,15
ING Groep NV				
2,125 % éch. 23/05/2026	€	400	407	0,06

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Volkswagen Financial Services NV				
1,125 % éch. 18/09/2023	£	200	$ 235	0,03
			4 506	0,63
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Jubilee Place BV				
2,378 % éch. 17/10/2057	€	986	1 044	0,14
Total Pays-Bas			5 550	0,77
NOUVELLE-ZÉLANDE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais				
1,500 % éch. 15/05/2031	NZD	1 300	655	0,09
NORVÈGE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Kommunalbanken A/S				
1,900 % éch. 19/01/2027	AUD	1 600	982	0,14
Obligation internationale du gouvernement norvégien				
1,750 % éch. 13/03/2025	NOK	6 300	622	0,08
Total Norvège			1 604	0,22
PÉROU				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % éch. 17/09/2024	PEN	2 400	588	0,08
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement péruvien				
5,350 % éch. 12/08/2040		1 900	373	0,05
5,940 % éch. 12/02/2029		9 700	2 336	0,33
6,150 % éch. 12/08/2032		2 000	462	0,06
6,350 % éch. 12/08/2028		17 400	4 341	0,61
6,950 % éch. 12/08/2031		2 200	545	0,08
			8 057	1,13
Total Pérou			8 645	1,21
POLOGNE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement polonais				
5,500 % éch. 16/11/2027	$	200	206	0,03
PORTUGAL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Espirito Santo S.A.				
4,000 % éch. 21/01/2019 ^	€	400	62	0,01
4,750 % éch. 15/01/2018 ^		700	108	0,01
EDP - Energias de Portugal S.A.				
2,375 % éch. 27/11/2023		800	850	0,12
Total Portugal			1 020	0,14
QATAR				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
QatarEnergy Trading LLC				
2,250 % éch. 12/07/2031	$	400	332	0,05
ROUMANIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement roumain				
1,375 % éch. 02/12/2029	€	630	491	0,07
1,750 % éch. 13/07/2030		1 000	746	0,10
2,000 % éch. 28/01/2032		600	429	0,06
2,000 % éch. 14/04/2033		700	481	0,07
2,124 % éch. 16/07/2031		400	296	0,04
2,625 % éch. 02/12/2040		600	359	0,05
2,875 % éch. 13/04/2042		800	480	0,07
3,750 % éch. 07/02/2034		800	639	0,09
Total Roumanie			3 921	0,55
SERBIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement serbe				
1,000 % éch. 23/09/2028		1 700	1 308	0,18

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
2,050 % éch. 23/09/2036	€	900	$ 545	0,08
Total Serbie			1 853	0,26
SLOVÉNIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % éch. 27/01/2025		700	678	0,10
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % éch. 05/02/2030		1 000	885	0,12
Total Slovénie			1 563	0,22
CORÉE DU SUD				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement sud-coréen				
2,125 % éch. 10/06/2027	KRW	2 095 000	1 545	0,21
2,375 % éch. 10/12/2027		2 480 000	1 837	0,26
2,375 % éch. 10/12/2028		10 348 000	7 590	1,06
2,625 % éch. 10/06/2028		4 190 000	3 128	0,44
5,500 % éch. 10/03/2028		2 480 000	2 119	0,30
Total Corée du Sud			16 219	2,27
ESPAGNE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
BBVA Consumer Auto				
0,270 % éch. 20/07/2031	€	534	558	0,08
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
5,875 % éch. 24/09/2023 (f)(h)		1 000	1 028	0,14
Banco Santander S.A.				
1,849 % éch. 25/03/2026	$	200	177	0,02
3,848 % éch. 12/04/2023		400	398	0,06
CaixaBank S.A.				
1,750 % éch. 24/10/2023	€	900	950	0,13
3,625 % éch. 14/09/2028 (f)(h)		1 800	1 357	0,19
			3 910	0,54
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Communauté autonome de Catalogne				
4,220 % éch. 26/04/2035		400	415	0,06
Obligation internationale du gouvernement espagnol				
1,450 % éch. 31/10/2071		2 200	1 077	0,15
1,900 % éch. 31/10/2052		300	204	0,03
3,450 % éch. 30/07/2066		4 200	3 964	0,55
5,250 % éch. 06/04/2029	£	500	619	0,09
			6 279	0,88
Total Espagne			10 747	1,50
SUPRANATIONALES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banque européenne pour la reconstruction et le développement				
0,500 % éch. 21/12/2023	AUD	3 100	2 028	0,28
Banque européenne d'investissement				
0,500 % éch. 21/07/2023		1 200	799	0,11
Banque interaméricaine de développement				
2,500 % éch. 14/04/2027		1 300	817	0,12
Total Supranationales			3 644	0,51
SUÈDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
EQT AB				
2,375 % éch. 06/04/2028	€	700	658	0,09
SUISSE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Credit Suisse AG				
3,625 % éch. 09/09/2024	$	500	467	0,07
6,500 % éch. 08/08/2023 (h)		700	679	0,10
Credit Suisse Group AG				
3,800 % éch. 09/06/2023		1 800	1 753	0,25
3,869 % éch. 12/01/2029		1 150	924	0,13
4,282 % éch. 09/01/2028	$	450	$ 374	0,05
4,550 % éch. 17/04/2026		750	662	0,09
6,250 % éch. 18/12/2024 (f)(h)		200	158	0,02
6,375 % éch. 21/08/2026 (f)(h)		200	144	0,02
7,500 % éch. 11/12/2023 (f)(h)		1 000	876	0,12
UBS Group AG				
4,488 % éch. 12/05/2026		400	391	0,05
4,751 % éch. 12/05/2028		400	383	0,05
Total Suisse			6 811	0,95
THAÏLANDE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais				
3,390 % éch. 17/06/2037	THB	15 276	460	0,06
3,450 % éch. 17/06/2043		109 900	3 221	0,45
Total Thaïlande			3 681	0,51
ÉMIRATS ARABES UNIS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
MDGH GMTN RSC Ltd.				
5,500 % éch. 28/04/2033	$	500	529	0,07
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Barclays PLC				
4,375 % éch. 12/01/2026		200	194	0,03
FCE Bank PLC				
1,615 % éch. 11/05/2023	€	400	423	0,06
GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC				
3,125 % éch. 24/03/2025	$	1 200	1 142	0,16
HSBC Holdings PLC				
2,251 % éch. 22/11/2027		2 300	1 995	0,28
2,804 % éch. 24/05/2032		2 200	1 707	0,24
2,999 % éch. 10/03/2026		500	470	0,07
3,950 % éch. 18/05/2024		400	397	0,05
4,041 % éch. 13/03/2028		300	277	0,04
4,583 % éch. 19/06/2029		1 300	1 199	0,17
5,674 % éch. 18/05/2024		1 000	996	0,14
Nationwide Building Society				
3,766 % éch. 08/03/2024		4 300	4 277	0,60
NatWest Markets PLC				
1,000 % éch. 28/05/2024	€	1 000	1 030	0,14
Santander UK Group Holdings PLC				
3,373 % éch. 05/01/2024	$	3 900	3 900	0,54
4,796 % éch. 15/11/2024		1 700	1 672	0,23
Standard Chartered PLC				
1,822 % éch. 23/11/2025		1 800	1 645	0,23
2,678 % éch. 29/06/2032		2 700	2 043	0,28
Tesco Property Finance PLC				
5,744 % éch. 13/04/2040	£	494	557	0,08
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % éch. 18/11/2028		700	621	0,09
			24 545	3,43
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Avon Finance PLC				
4,331 % éch. 20/09/2048		1 246	1 471	0,21
Canada Square Funding PLC				
4,205 % éch. 17/06/2058		1 331	1 541	0,22
Eurosail PLC				
4,461 % éch. 13/06/2045		562	668	0,09
Finsbury Square PLC				
4,419 % éch. 16/12/2069		623	749	0,10
Genesis Mortgage Funding PLC				
4,603 % éch. 15/09/2059		2 870	3 379	0,47
Mansard Mortgages PLC				
4,172 % éch. 15/12/2049		462	534	0,07
Newgate Funding PLC				
2,646 % éch. 15/12/2050	€	454	451	0,06
Polaris PLC				
4,222 % éch. 23/12/2058	£	1 461	1 715	0,24
Ripon Mortgages PLC				
4,011 % éch. 28/08/2056		6 286	7 422	1,04
RMAC PLC				
4,206 % éch. 12/06/2046	£	888	$ 1 063	0,15
4,476 % éch. 12/06/2046		1 005	1 204	0,17
Stratton Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2060		2 589	3 088	0,43
4,287 % éch. 12/03/2052		1 294	1 550	0,22
Towd Point Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2045		2 754	3 277	0,46
4,071 % éch. 20/10/2051		1 259	1 505	0,21
Trinity Square PLC				
3,729 % éch. 15/07/2059		1 224	1 455	0,20
			31 072	4,34
			ACTIONS	
TITRES PRIVILÉGIÉS				
Nationwide Building Society				
10,250 %		2 470	372	0,05
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Bon du Trésor britannique				
0,625 % éch. 22/10/2050	£	2 700	1 452	0,20
1,250 % éch. 31/07/2051		3 500	2 277	0,32
1,500 % éch. 31/07/2053		1 600	1 105	0,16
1,750 % éch. 22/01/2049		2 200	1 695	0,24
3,250 % éch. 22/01/2044		1 700	1 818	0,25
4,250 % éch. 07/12/2040		1 700	2 096	0,29
			10 443	1,46
Total Royaume-Uni			66 432	9,28
ÉTATS-UNIS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Amortizing Residential Collateral Trust				
5,089 % éch. 25/10/2031	$	2	2	0,00
Asset-Backed Funding Certificates Trust				
5,089 % éch. 25/06/2034		96	90	0,01
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
5,004 % éch. 25/02/2036		2 436	2 364	0,33
5,389 % éch. 25/10/2037		11	11	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust				
4,549 % éch. 25/12/2036		1 790	1 009	0,14
Countrywide Asset-Backed Certificates				
5,069 % éch. 25/12/2036 ^		10	7	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,529 % éch. 25/06/2037		1 279	1 172	0,16
4,529 % éch. 25/07/2037		372	336	0,05
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
4,598 % éch. 25/01/2032		2	2	0,00
Home Equity Mortgage Trust				
6,000 % éch. 25/01/2037 ^		262	245	0,03
IndyMac Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
4,069 % éch. 25/03/2035		2 012	1 917	0,27
Long Beach Mortgage Loan Trust				
4,689 % éch. 25/05/2036		1 148	668	0,09
Massachusetts Educational Financing Authority				
5,308 % éch. 25/04/2038		104	104	0,01
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
4,629 % éch. 25/10/2036		2 075	1 847	0,26
4,709 % éch. 25/08/2036		5 169	1 850	0,26
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
4,549 % éch. 25/09/2037		4	1	0,00
4,629 % éch. 25/02/2037		3 104	948	0,13
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
4,489 % éch. 25/11/2036		1 153	695	0,10
4,639 % éch. 25/07/2036		100	84	0,01
New Century Home Equity Loan Trust				
3,740 % éch. 20/06/2031		271	233	0,03
Option One Mortgage Loan Trust				
4,529 % éch. 25/01/2037		579	388	0,05
4,529 % éch. 25/02/2037		2 099	1 412	0,20
Residential Asset Securities Corp. Trust				
5,049 % éch. 25/11/2035		61	61	0,01
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
4,509 % éch. 25/12/2036 ^		14	3	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
SLC Student Loan Trust				
5,574 % éch. 25/11/2042	$	494	$ 491	0,07
Soundview Home Loan Trust				
4,794 % éch. 25/12/2036		3 000	2 899	0,41
4,889 % éch. 25/11/2036		2 222	2 060	0,29
5,094 % éch. 25/11/2035		299	291	0,04
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
5,620 % éch. 25/04/2035		39	38	0,01
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
4,734 % éch. 25/01/2037		2 286	2 189	0,31
			23 417	3,27
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AbbVie, Inc.				
1,500 % éch. 15/11/2023	€	100	105	0,02
American Tower Corp.				
2,950 % éch. 15/01/2025	$	1 400	1 336	0,19
3,800 % éch. 15/08/2029		800	727	0,10
Bank of America Corp.				
1,949 % éch. 27/10/2026	€	1 000	1 003	0,14
2,551 % éch. 04/02/2028	$	700	623	0,09
2,972 % éch. 04/02/2033		700	566	0,08
3,384 % éch. 02/04/2026		600	574	0,08
4,376 % éch. 27/04/2028		400	383	0,05
Bayer U.S. Finance LLC				
4,375 % éch. 15/12/2028		300	282	0,04
5,779 % éch. 15/12/2023		900	898	0,13
Boeing Co.				
1,167 % éch. 04/02/2023		300	299	0,04
1,433 % éch. 04/02/2024		1 300	1 246	0,17
1,950 % éch. 01/02/2024		100	96	0,01
2,750 % éch. 01/02/2026		2 100	1 948	0,27
3,250 % éch. 01/02/2028		400	364	0,05
Broadcom, Inc.				
2,450 % éch. 15/02/2031		600	474	0,07
2,600 % éch. 15/02/2033		300	226	0,03
3,187 % éch. 15/11/2036		25	18	0,00
4,150 % éch. 15/11/2030		202	182	0,03
4,926 % éch. 15/05/2037		272	238	0,03
Charter Communications Operating LLC				
3,500 % éch. 01/03/2042		1 000	644	0,09
5,125 % éch. 01/07/2049		700	532	0,07
Citigroup, Inc.				
3,290 % éch. 17/03/2026 (j)		2 200	2 093	0,29
Corebridge Financial, Inc.				
3,650 % éch. 05/04/2027		600	560	0,08
Dell International LLC				
5,450 % éch. 15/06/2023		80	80	0,01
Doctors Co. An Interinsurance Exchange				
4,500 % éch. 18/01/2032		200	161	0,02
Ford Motor Credit Co. LLC				
2,748 % éch. 14/06/2024	£	600	684	0,10
2,900 % éch. 16/02/2028	$	100	83	0,01
3,375 % éch. 13/11/2025		800	725	0,10
4,687 % éch. 09/06/2025		600	572	0,08
GA Global Funding Trust				
2,250 % éch. 06/01/2027		600	529	0,07
Goldman Sachs Group, Inc.				
0,250 % éch. 26/01/2028	€	1 000	876	0,12
1,250 % éch. 07/02/2029		1 100	978	0,14
1,375 % éch. 15/05/2024		1 400	1 463	0,21
2,732 % éch. 07/02/2025		1 000	1 065	0,15
Hyatt Hotels Corp.				
1,300 % éch. 01/10/2023	$	500	486	0,07
JetBlue Pass-Through Trust				
4,000 % éch. 15/05/2034		869	775	0,11
JPMorgan Chase & Co.				
2,595 % éch. 24/02/2026		1 800	1 694	0,24
4,323 % éch. 26/04/2028		1 100	1 052	0,15
4,912 % éch. 25/07/2033		700	669	0,09
Kilroy Realty LP				
3,450 % éch. 15/12/2024		200	192	0,03
Lehman Brothers Holdings, Inc.				
0,000 % éch. 16/11/2009 ^		700	3	0,00
5,625 % éch. 24/01/2013 ^		600	2	0,00
6,200 % éch. 26/09/2014 ^		1 400	5	0,00
7,875 % éch. 08/05/2018 ^	£	1 800	11	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Morgan Stanley				
2,630 % éch. 18/02/2026	$	1 300	$ 1 222	0,17
2,950 % éch. 07/05/2032	€	700	664	0,09
ONEOK, Inc.				
4,550 % éch. 15/07/2028	$	300	284	0,04
Oracle Corp.				
2,300 % éch. 25/03/2028 (j)		2 400	2 083	0,29
2,875 % éch. 25/03/2031 (j)		600	499	0,07
3,950 % éch. 25/03/2051 (j)		100	72	0,01
4,100 % éch. 25/03/2061 (j)		700	489	0,07
Organon & Co.				
4,125 % éch. 30/04/2028		400	355	0,05
5,125 % éch. 30/04/2031		500	434	0,06
Pacific Gas & Electric Co.				
2,100 % éch. 01/08/2027		100	86	0,01
2,950 % éch. 01/03/2026 ^		100	92	0,01
3,150 % éch. 01/01/2026		100	93	0,01
3,450 % éch. 01/07/2025		100	95	0,01
3,950 % éch. 01/12/2047 ^		100	68	0,01
4,250 % éch. 15/03/2046 ^		300	210	0,03
4,300 % éch. 15/03/2045 ^		100	71	0,01
4,550 % éch. 01/07/2030		200	182	0,03
Penske Truck Leasing Co. LP				
3,950 % éch. 10/03/2025		1 500	1 446	0,20
Southern California Edison Co.				
0,700 % éch. 03/04/2023		500	495	0,07
4,963 % éch. 03/04/2023		200	200	0,03
5,153 % éch. 01/04/2024		500	497	0,07
WEA Finance LLC				
3,750 % éch. 17/09/2024		600	567	0,08
Wells Fargo & Co.				
3,526 % éch. 24/03/2028		700	649	0,09
3,908 % éch. 25/04/2026		800	778	0,11
			39 153	5,47
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
CenturyLink, Inc.				
6,634 % éch. 15/03/2027		823	783	0,11
OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX				
Billets Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021				
2,158 % éch. 01/06/2026		900	809	0,11
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,361 % éch. 25/09/2035 ^		11	10	0,00
American Home Mortgage Assets Trust				
2,988 % éch. 25/10/2046		898	626	0,09
4,579 % éch. 25/05/2046 ^		203	165	0,02
Banc of America Funding Trust				
3,860 % éch. 20/10/2046 ^		93	77	0,01
4,273 % éch. 20/01/2047 ^		36	33	0,01
4,673 % éch. 20/02/2047		722	643	0,09
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
2,634 % éch. 25/05/2034		11	10	0,00
3,236 % éch. 25/08/2033		5	5	0,00
3,255 % éch. 25/05/2047 ^		134	119	0,02
3,789 % éch. 25/10/2033		7	6	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,586 % éch. 25/11/2036 ^		392	210	0,03
3,729 % éch. 25/09/2035 ^		261	162	0,02
3,763 % éch. 25/11/2035 ^		127	101	0,02
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				
5,219 % éch. 26/12/2046 ^		423	305	0,04
Chase Mortgage Finance Trust				
3,718 % éch. 25/07/2037		44	36	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust				
3,871 % éch. 25/09/2037 ^		240	207	0,03
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
3,790 % éch. 25/09/2035		17	16	0,00
4,575 % éch. 25/08/2035 ^		291	267	0,04
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates				
2,994 % éch. 25/09/2035 ^		322	274	0,04
CitiMortgage Alternative Loan Trust				
4,989 % éch. 25/02/2037		1 973	1 654	0,23

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Countrywide Alternative Loan Trust				
3,435 % éch. 25/02/2037 ^	$	121	$ 103	0,02
3,548 % éch. 25/11/2035		61	51	0,01
4,088 % éch. 25/11/2035		24	21	0,00
4,098 % éch. 20/10/2035		1 179	812	0,11
4,533 % éch. 20/02/2047 ^		758	575	0,08
4,563 % éch. 20/07/2046 ^		193	144	0,02
4,739 % éch. 25/05/2037 ^		67	25	0,00
5,250 % éch. 25/06/2035 ^		19	15	0,00
5,929 % éch. 25/11/2035		140	111	0,02
6,000 % éch. 25/07/2037		2 003	1 068	0,15
6,250 % éch. 25/08/2037 ^		54	29	0,00
6,500 % éch. 25/06/2036 ^		155	78	0,01
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
3,680 % éch. 25/08/2034 ^		1	1	0,00
3,792 % éch. 25/11/2034		5	5	0,00
4,849 % éch. 25/05/2035		21	17	0,00
5,029 % éch. 25/03/2035		96	80	0,01
5,049 % éch. 25/02/2035		52	47	0,01
5,149 % éch. 25/09/2034		5	5	0,00
6,000 % éch. 25/02/2037		936	475	0,07
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				
4,729 % éch. 25/06/2035		114	108	0,02
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				
4,629 % éch. 25/08/2036 ^		411	369	0,05
Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust				
4,489 % éch. 25/10/2036 ^		4	3	0,00
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				
4,859 % éch. 19/08/2045		50	42	0,01
4,979 % éch. 19/07/2045 ^		3	0	0,00
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				
3,875 % éch. 25/08/2035		14	9	0,00
Greenpoint Mortgage Funding Trust				
4,929 % éch. 25/11/2045		15	13	0,00
GSR Mortgage Loan Trust				
2,880 % éch. 25/03/2033		4	4	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust				
2,898 % éch. 19/12/2036 ^		119	98	0,01
4,048 % éch. 19/10/2035		387	221	0,03
Impac CMB Trust				
5,389 % éch. 25/07/2033		1	1	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust				
3,014 % éch. 25/03/2036		511	349	0,05
3,837 % éch. 25/12/2034		8	8	0,00
JPMorgan Alternative Loan Trust				
4,869 % éch. 25/10/2036		272	239	0,03
5,500 % éch. 25/11/2036 ^		2	1	0,00
JPMorgan Mortgage Trust				
3,062 % éch. 25/11/2033		5	4	0,00
3,196 % éch. 27/07/2037		177	161	0,02
3,478 % éch. 25/02/2036 ^		95	71	0,01
MASTR Alternative Loan Trust				
4,789 % éch. 25/03/2036 ^		87	10	0,00
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				
4,758 % éch. 15/12/2030		11	10	0,00
Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust				
4,609 % éch. 25/03/2037		6 116	1 759	0,25
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
3,483 % éch. 25/11/2037		721	586	0,08
4,539 % éch. 25/02/2047		166	61	0,01
4,689 % éch. 25/06/2037 ^		317	283	0,04
4,709 % éch. 25/03/2047		731	643	0,09
4,749 % éch. 25/07/2036 ^		1 099	467	0,07
4,749 % éch. 25/06/2046		792	185	0,03
5,189 % éch. 25/10/2045		64	52	0,01
6,000 % éch. 25/06/2036		385	311	0,04
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				
3,910 % éch. 25/09/2035 ^		38	24	0,00
6,500 % éch. 25/03/2032		0	0	0,00
Sequoia Mortgage Trust				
3,194 % éch. 20/07/2037		492	395	0,06
5,053 % éch. 20/07/2033		15	14	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,780 % éch. 25/02/2034		13	12	0,00
3,957 % éch. 25/04/2034		15	15	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
4,709 % éch. 25/01/2037	$	1 103	$ 956	0,13
4,769 % éch. 25/07/2046 ^		344	239	0,03
4,809 % éch. 25/05/2036		130	98	0,01
4,829 % éch. 25/05/2036		648	496	0,07
4,919 % éch. 19/07/2034		6	6	0,00
5,039 % éch. 19/03/2034		3	3	0,00
Structured Asset Securities Corp.				
4,669 % éch. 25/01/2036		165	158	0,02
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
4,679 % éch. 25/10/2036		475	416	0,06
Thornburg Mortgage Securities Trust				
6,666 % éch. 25/06/2047 ^		89	76	0,01
Wachovia Mortgage Loan Trust				
1,276 % éch. 25/01/2037		1 476	586	0,08
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
2,585 % éch. 25/03/2034		1	1	0,00
2,835 % éch. 27/02/2034		7	6	0,00
3,048 % éch. 25/02/2046		194	171	0,02
3,240 % éch. 25/06/2037 ^		106	93	0,01
3,290 % éch. 25/02/2037 ^		689	622	0,09
3,342 % éch. 25/05/2037 ^		394	343	0,05
3,565 % éch. 25/09/2036		137	117	0,02
5,009 % éch. 25/01/2045		15	15	0,00
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
2,988 % éch. 25/07/2046 ^		80	49	0,01
			19 567	2,73
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Fannie Mae				
2,889 % éch. 01/09/2044		43	41	0,01
2,944 % éch. 25/07/2039		369	327	0,05
3,000 % éch. 01/03/2060		842	742	0,10
3,465 % éch. 01/10/2034		1	1	0,00
3,500 % éch. 01/01/2059		1 774	1 630	0,23
3,632 % éch. 01/12/2034		10	10	0,00
3,887 % éch. 25/03/2036		3	3	0,00
4,027 % éch. 01/11/2034		46	47	0,01
4,509 % éch. 25/03/2034		3	3	0,00
4,539 % éch. 25/08/2034		4	4	0,00
4,789 % éch. 25/06/2036		19	19	0,00
4,889 % éch. 25/10/2040		40	39	0,01
6,000 % éch. 25/04/2043 - 25/07/2044		88	89	0,01
Freddie Mac				
0,000 % éch. 15/01/2038 (a)		315	12	0,00
2,889 % éch. 25/02/2045		50	50	0,01
3,248 % éch. 25/10/2044		133	132	0,02
3,358 % éch. 15/01/2038		315	315	0,04
4,021 % éch. 01/09/2035		2	2	0,00
4,918 % éch. 15/12/2037 - 15/07/2040		140	139	0,02
5,389 % éch. 25/05/2043		20	19	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Ginnie Mae				
3,000 % éch. 20/07/2046 - 20/05/2047	$	25	$ 24	0,00
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)				
2,500 % éch. 01/02/2051 - 01/01/2052		2 829	2 404	0,34
3,000 % éch. 01/04/2043 - 01/06/2051		1 938	1 718	0,24
3,500 % éch. 01/10/2034 - 01/07/2050		1 548	1 439	0,20
4,000 % éch. 01/06/2050		750	710	0,10
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				
3,000 % éch. 01/02/2053		23 500	20 647	2,88
3,500 % éch. 01/02/2053		16 300	14 820	2,07
4,000 % éch. 01/03/2053		22 400	21 021	2,94
4,500 % éch. 01/02/2053		42 300	40 722	5,69
6,000 % éch. 01/01/2053		5 700	5 781	0,80
			112 910	15,77
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Obligations du Trésor américain				
1,625 % éch. 15/11/2050		400	238	0,03
4,000 % éch. 15/11/2052		200	201	0,03
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e)				
0,125 % éch. 15/07/2031		2 891	2 556	0,36
0,125 % éch. 15/01/2032		1 182	1 037	0,14
0,500 % éch. 15/01/2028		6 402	6 023	0,84
0,625 % éch. 15/07/2032		410	376	0,05
1,750 % éch. 15/01/2028		569	569	0,08
2,375 % éch. 15/01/2027		739	754	0,11
2,500 % éch. 15/01/2029		4 996	5 212	0,73
3,875 % éch. 15/04/2029		1 631	1 834	0,26
Billets du Trésor américain				
0,125 % éch. 15/12/2023		300	287	0,04
			19 087	2,67
Total États-Unis			215 726	30,13
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BONS DU TRÉSOR HONGROIS				
18,250 % éch. 03/01/2023 (c)(d)	HUF	2 147 000	5 722	0,80
BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN				
0,011 % éch. 04/01/2023 (c)(d)	ILS	3 800	1 076	0,15
0,022 % éch. 04/01/2023 (c)(d)		7 200	2 040	0,28
1,184 % éch. 02/03/2023 (c)(d)		25 600	7 212	1,01
1,716 % éch. 05/07/2023 (c)(d)		2 200	612	0,09
1,718 % éch. 03/05/2023 (c)(d)		7 000	1 961	0,27
			12 901	1,80

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS				
(0,256) % éch. 11/01/2023 (c)(d)	¥	3 004 300	$ 22 770	3,18
(0,249) % éch. 11/01/2023 (c)(d)		1 000	8	0,00
(0,242) % éch. 23/01/2023 (c)(d)		9 000	68	0,01
(0,228) % éch. 11/01/2023 (c)(d)		2 325 700	17 627	2,46
(0,209) % éch. 06/01/2023 (c)(d)		1 231 000	9 330	1,30
(0,205) % éch. 16/01/2023 (c)(d)		1 360 000	10 308	1,44
(0,191) % éch. 06/01/2023 (c)(d)		459 000	3 479	0,49
(0,190) % éch. 16/01/2023 (c)(d)		1 180 000	8 944	1,25
(0,162) % éch. 23/01/2023 (c)(d)		135 000	1 023	0,14
(0,160) % éch. 23/01/2023 (c)(d)		1 907 000	14 454	2,02
(0,151) % éch. 23/01/2023 (c)(d)		1 028 000	7 792	1,09
(0,147) % éch. 06/02/2023 (c)(d)		1 929 000	14 622	2,04
(0,138) % éch. 06/02/2023 (c)(d)		871 000	6 602	0,92
(0,138) % éch. 06/03/2023 (c)(d)		312 000	2 365	0,33
(0,123) % éch. 27/02/2023 (c)(d)		1 020 000	7 733	1,08
(0,111) % éch. 20/02/2023 (c)(d)		840 000	6 368	0,89
			133 493	18,64
Total des Instruments à court terme			152 116	21,24
Total des Valeurs mobilières			**$ 737 412**	**102,98**
		ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT				
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)		4 168 885	41 497	5,80
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (g)		402 852	5 366	0,75
			46 863	6,55
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE				
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (g)		4 450	459	0,06
Total des Fonds d'investissement			**$ 47 322**	**6,61**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
FICC	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 1 625	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 29/06/2023	$ (1 658)	$ 1 625	$ 1 625	0,23
Total des Contrats de mise en pension						**$ (1 658)**	**$ 1 625**	**$ 1 625**	**0,23**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2024	694	$ 276	0,04
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Long	09/2023	418	(474)	(0,06)

Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Long	09/2024	347	$ (107)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans mars	Court	03/2023	56	51	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars	Long	03/2023	146	(654)	(0,09)
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	7	6	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars	Court	03/2023	131	209	0,03
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Court	03/2023	296	782	0,11
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	Long	03/2023	94	(811)	(0,11)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	Court	03/2023	190	301	0,04
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	38	322	0,05
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	Long	03/2023	15	(409)	(0,06)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars	Court	03/2023	255	2 459	0,34
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars	Long	03/2023	238	(355)	(0,05)
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Long	03/2023	47	(964)	(0,13)
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	7	(36)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Court	03/2023	148	(41)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	439	(64)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	25	(7)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	6	(5)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	431	373	0,05
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Court	03/2023	109	805	0,11
				$ 1 657	0,24

[1] Option de style contrat à terme standardisé.

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Nbre de Contrats	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	$ 98,000	15/12/2023	13	$ (11)	$ (1)	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	13	(12)	(40)	(0,01)
				$ (23)	$ (41)	(0,01)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					**$ 1 616**	**0,23**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
British Telecommunications PLC	1,000 %	20/06/2028	€ 700	$ (20)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/12/2024	$ 100	(1)	0,00
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5,000	20/06/2026	€ 500	(97)	(0,01)
Rolls-Royce PLC	1,000	20/06/2024	900	29	0,00
Stellantis NV	5,000	20/12/2026	500	(40)	(0,01)
Tesco PLC	1,000	20/06/2025	1 500	(29)	0,00
				$ (158)	(0,02)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION[2]

Indices/Tranches	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.IG-35 à 10 ans	(1,000) %	20/12/2030	$ 10 300	$ 98	0,01
Indice CDX.IG-37 à 10 ans	(1,000)	20/12/2031	16 500	101	0,01
Indice CDX.IG-38 à 10 ans	(1,000)	20/06/2032	2 200	(13)	0,00
Indice CDX.IG-39 à 10 ans	(1,000)	20/12/2032	60 600	(807)	(0,11)
Indice iTraxx Europe Main 37 à 10 ans	(1,000)	20/06/2032	€ 3 000	(42)	(0,01)
Indice iTraxx Europe Main 38 à 10 ans	(1,000)	20/12/2032	9 800	(230)	(0,03)
				$ (893)	(0,13)

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT - SWAPS DE BASE

Indice de taux variable à payer	Indice de taux variable à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,070 %	07/03/2024	$ 7 400	$ 6	0,00
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,102 %	04/10/2024	15 000	43	0,01
				$ 49	0,01

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	0,010 %	07/02/2023	£ 34 350	$ (686)	(0,10)
À payer[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2033	27 100	(70)	(0,01)
À payer[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053	2 800	(15)	0,00
À payer[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250	15/03/2028	14 000	(495)	(0,07)
À payer[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,500	15/03/2025	2 800	(35)	0,00
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	5,750	16/03/2027	INR 1 130 580	(443)	(0,06)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250	21/09/2023	2 356 900	(96)	(0,01)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250	21/09/2024	648 240	(21)	0,00
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250	16/03/2032	116 100	(90)	(0,01)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,500	21/09/2024	638 533	31	0,00
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,500	21/09/2027	300 100	(36)	(0,01)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,750	21/09/2024	1 151 300	73	0,01
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	7,000	21/09/2027	262 600	(63)	(0,01)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2023	¥ 2 430 000	(45)	(0,01)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2026	970 000	(84)	(0,01)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2028	10 000	(3)	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	17/03/2031	610 000	(266)	(0,04)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,050	15/12/2031	851 000	(251)	(0,04)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	19/06/2039	540 000	554	0,08
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	15/12/2051	80 000	(124)	(0,02)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,450	15/12/2051	230 000	(142)	(0,02)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,800	15/06/2052	640 000	(302)	(0,04)
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/09/2031	SGD 200	(7)	0,00
À recevoir	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/09/2031	200	23	0,00
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	2,500	21/09/2027	4 300	(77)	(0,01)
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	2,750	15/06/2027	6 400	(77)	(0,01)
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	2,750	21/09/2027	18 000	(88)	(0,01)
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	3,000	15/06/2027	2 400	(9)	0,00
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/12/2027	470	(2)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2027	$ 16 900	1 460	0,20
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2029	37 300	(3 550)	(0,50)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/12/2028	5 600	(749)	(0,10)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,618	09/02/2029	2 700	(299)	(0,04)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,695	15/11/2031	16 600	(2 366)	(0,33)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024	9 600	2	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027	88 500	2 523	0,35
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2029	5 200	252	0,04
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	11 670	(161)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2052	1 980	52	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,888	22/03/2029	4 300	(416)	(0,06)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,175	21/04/2029	4 000	(325)	(0,05)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,750	30/04/2029	2 400	127	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,817	30/04/2029	8 300	407	0,06
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,818	30/04/2029	6 200	303	0,04
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,819	30/04/2029	4 200	205	0,03
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,906	16/09/2052	2 300	(139)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,965	30/06/2024	15 900	(428)	(0,06)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,965	30/11/2026	61 700	2 065	0,29
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,968	30/06/2024	15 900	(427)	(0,06)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029	500	(15)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,100	09/09/2029	2 100	(56)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,454	30/06/2029	5 400	(59)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,828	15/05/2032	3 600	(76)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,898	30/06/2029	5 000	72	0,01
À recevoir[4]	BBR-BBSW AUD à 3 mois	3,750	15/03/2024	AUD 93 200	88	0,01
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,220	03/03/2025	CAD 6 900	(402)	(0,06)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,250	16/06/2031	5 500	(128)	(0,02)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2025	9 600	(487)	(0,07)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2030	9 200	(787)	(0,11)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	16/06/2051	250	(35)	(0,01)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,585	19/07/2031	7 100	(673)	(0,09)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,713	02/10/2029	2 100	(178)	(0,02)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,900	18/12/2029	24 500	(2 101)	(0,29)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,283	14/02/2027	CHF 900	(55)	(0,01)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,294	10/02/2027	8 500	(488)	(0,07)
À payer	SRFXON3 CHF composé-OIS à 3 mois	0,343	16/05/2027	1 900	(123)	(0,02)
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	16/03/2027	CNY 61 000	(97)	(0,01)
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	21/12/2027	102 700	(162)	(0,02)
À payer	ESTRON EUR composé-OIS à 3 mois	1,000	23/11/2024	€ 17 300	(183)	(0,03)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,000	21/09/2027	KRW 20 573 370	(394)	(0,06)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,000	15/06/2032	2 883 300	(95)	(0,01)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	15/06/2032	885 300	(17)	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	0,528	17/03/2024	NZD 650	(21)	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,000	01/11/2023	22 600	(309)	(0,04)
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,000	15/12/2023	24 900	(365)	(0,05)
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,750	15/06/2027	9 400	(169)	(0,02)
À payer[4]	BBR NZD à 3 mois	4,000	14/06/2024	32 500	(248)	(0,03)
À payer	STIBOR SEK à 3 mois	0,500	19/06/2024	SEK 56 200	(290)	(0,04)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,400	15/01/2028	$ 24 600	(2 883)	(0,40)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,750	16/06/2031	15 710	2 321	0,32

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,249 %	31/08/2024	$ 11 650	$ 922	0,13
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	15/12/2026	63 400	7 507	1,05
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,298	25/08/2024	10 200	817	0,11
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	15/12/2028	19 300	(2 801)	(0,39)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,518	20/01/2029	1 500	(194)	(0,03)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	20/01/2029	4 400	(541)	(0,08)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,250	20/06/2023	ZAR 16 700	(67)	(0,01)
À recevoir	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,250	17/06/2030	AUD 5 100	574	0,08
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	1,750	16/03/2027	6 600	(423)	(0,06)
À payer[4]	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	15/09/2032	1 900	(28)	0,00
À payer[4]	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	15/03/2033	1 600	(26)	0,00
À payer[4]	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,500	15/09/2032	58 600	(586)	(0,08)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,913	30/01/2029	CZK 24 300	(193)	(0,03)
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	0,054	27/05/2050	€ 450	110	0,02
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,064	17/11/2052	1 000	341	0,05
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	900	(39)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027	2 400	(246)	(0,03)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	11/05/2027	1 800	(184)	(0,03)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027	1 400	(140)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	2 200	(195)	(0,03)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	1 300	(115)	(0,02)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2025	45 200	(948)	(0,13)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028	97 000	(3 149)	(0,44)
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053	9 300	527	0,07
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	78 650	(2 157)	(0,30)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	21/09/2037	8 950	(1 109)	(0,16)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,250	21/09/2042	1 260	(230)	(0,03)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	19/03/2027	11 660	(14)	0,00
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	3,000	15/03/2033	5 200	16	0,00
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,500	20/03/2024	HUF 342 600	(138)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	4,870	07/07/2025	MXN 86 100	(241)	(0,03)
					$ (15 675)	(2,19)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ (16 677)**	**(2,33)**

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,180 %	11/01/2024	3 600	$ 103	$ 381	0,05

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Option de vente - Obligation internationale du gouvernement français hors cote, 0,750 % échéance 25/05/2052	€ 97,000	23/05/2025	1 600	$ 121	$ 654	0,09

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente - Indice iTraxx Europe 37 à 5 ans hors cote	Vente	3,000 %	15/03/2023	1 800	$ (3)	$ 0	0,00

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150 %	01/12/2023	1 900	$ (6)	$ (1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	01/12/2023	1 900	(6)	(14)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,310	11/01/2024	31 500	(102)	(522)	(0,07)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	19/01/2023	500	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,500	19/01/2023	500	(2)	(6)	0,00
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	11/04/2023	3 300	(3)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	11/04/2023	3 300	(10)	(51)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	28/04/2023	2 100	(4)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	28/04/2023	2 100	(4)	(30)	(0,01)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 25 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,451	23/05/2025	1 600	(121)	(612)	(0,09)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	23/01/2023	500	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,770	23/01/2023	500	(1)	(3)	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	19/01/2023	300	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,500	19/01/2023	300	(1)	(4)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	12/01/2023	800	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	12/01/2023	800	(2)	(3)	0,00
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,150	09/01/2023	2 400	(8)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	09/01/2023	2 400	(8)	(15)	0,00
DUB	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	1 100	(7)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	1 100	(7)	(15)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,790	08/04/2024	2 800	(22)	(8)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,790	08/04/2024	2 800	(22)	(32)	(0,01)
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	800	(5)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	800	(5)	(11)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	800	(5)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	800	(5)	(10)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	900	(6)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	900	(6)	(11)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	800	(6)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	800	(6)	(9)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	900	(6)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	900	(6)	(10)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	1 100	(8)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	1 100	(8)	(14)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	800	(5)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	800	(5)	(11)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	500	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,088	03/11/2023	500	(4)	(6)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,910	10/11/2023	1 700	(11)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,910	10/11/2023	1 700	(11)	(22)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	3 000	(11)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	3 000	(11)	(22)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	1 500	(5)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/11/2023	1 500	(5)	(12)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	1 400	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	1 400	(4)	(10)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,697	02/04/2024	3 400	(27)	(10)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,697	02/04/2024	3 400	(27)	(43)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,721	08/04/2024	900	(7)	(3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,721	08/04/2024	900	(7)	(11)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	05/04/2023	6 500	(12)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	05/04/2023	6 500	(12)	(100)	(0,02)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	11/04/2023	11 400	(22)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	11/04/2023	11 400	(22)	(178)	(0,03)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	24/04/2023	1 600	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	24/04/2023	1 600	(5)	(23)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	26/04/2023	2 200	(4)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	26/04/2023	2 200	(4)	(31)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	15/05/2023	4 000	(7)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	15/05/2023	4 000	(7)	(64)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	2 000	(23)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	2 000	(28)	(66)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,230	23/01/2023	1 900	(5)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,730	23/01/2023	1 900	(5)	(11)	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À recevoir	0,820	16/12/2024	8 700	(61)	(13)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	12/01/2023	900	(3)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	12/01/2023	900	(3)	(3)	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,993	11/10/2023	700	(5)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,993	11/10/2023	700	(5)	(9)	0,00
							$ (797)	$ (2 051)	(0,28)

(1) Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000) %	20/06/2023	$ 3 100	$ (76)	$ 65	$ (11)	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement chinois	(1,000)	20/06/2023	1 600	(31)	25	(6)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/06/2023	4 400	(111)	95	(16)	(0,01)

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Obligation internationale du gouvernement chinois	(1,000) %	20/06/2023	$ 2 900	$ (56)	$ 45	$ (11)	0,00
HUS	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/06/2023	1 500	(38)	33	(5)	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement sud-coréen	(1,000)	20/06/2023	2 100	(50)	43	(7)	0,00
					$ (362)	$ 306	$ (56)	(0,01)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[2]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BRC	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000 %	20/06/2025	$ 1 500	$ (37)	$ 44	$ 7	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	1 000	(24)	29	5	0,00
					$ (61)	$ 73	$ 12	0,00

(1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS SUR DEVISES CROISÉES

Contrepartie	À recevoir	À payer	Date d'échéance	Montant notionnel de la devise reçue	Montant notionnel de la devise livrée	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
AZD	Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,290 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	04/01/2031	AUD 5 900	$ 4 445	$ 29	$ (17)	$ 12	0,00
CBK	Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,420 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	31/07/2029	7 100	4 899	(2)	10	8	0,00
GLM	Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,423 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	01/08/2029	7 000	4 830	(14)	10	(4)	0,00
MYC	Taux variable égal à LIBOR AUD à 3 mois plus 0,298 % sur la base du montant notionnel de la devise reçue	Taux variable égal à LIBOR USD à 3 mois basé sur le montant notionnel de la devise livrée	14/10/2030	2 000	1 437	9	(5)	4	0,00
						$ 22	$ (2)	$ 20	0,00

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,250 %	16/03/2032	MYR 2 116	$ 4	$ 25	$ 29	0,01
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	21/09/2027	9 800	4	21	25	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	4,000	21/09/2027	16 256	19	(62)	(43)	(0,01)
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000	21/09/2024	THB 156 400	(7)	(1)	(8)	0,00
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	21/12/2027	250 400	(36)	23	(13)	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	16/03/2032	31 900	5	(41)	(36)	(0,01)
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	15/06/2032	30 200	(4)	(35)	(39)	(0,01)
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,750	21/09/2032	37 180	(1)	30	29	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	3,250	15/06/2032	800	0	2	2	0,00
BPS	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	15/06/2032	2 700	(1)	(2)	(3)	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	3,250	15/06/2032	18 500	3	30	33	0,01
CBK	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	16/03/2032	MYR 2 800	1	24	25	0,00
GLM	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	21/09/2032	1 200	(1)	7	6	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	15/06/2032	THB 18 800	(1)	(24)	(25)	0,00
	À payer	THBFIX THB à 6 mois	3,250	15/06/2032	4 500	1	7	8	0,00
GST	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000	21/09/2024	465 700	(49)	25	(24)	0,00
JPM	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000	15/06/2032	42 900	(5)	(52)	(57)	(0,01)

Contrepartie	Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
MBC	À payer	THBFIX THB à 6 mois	2,000 %	15/06/2032	THB 23 900	$ (6)	$ (26)	$ (32)	0,00
SCX	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	16/03/2032	MYR 2 300	(7)	28	21	0,00
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000	21/09/2024	THB 462 505	19	(43)	(24)	0,00
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000	21/09/2027	3 350	0	1	1	0,00
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	21/09/2027	191 600	(34)	22	(12)	0,00
						$ (96)	$ (41)	$ (137)	(0,02)

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

Contrepartie	À payer/à recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel	Date d'échéance	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	À recevoir	Indice iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	S/O	1,058	$ 5 400	20/09/2023	$ 42	$ 140	$ 182	0,03
BPS	À recevoir	Indice iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	S/O	1,059	14 200	20/06/2023	60	118	178	0,02
	À recevoir	Indice iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	S/O	1,058	4 645	20/09/2023	36	101	137	0,02
MYC	À recevoir	Indice iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	S/O	1,059	1 700	20/06/2023	7	14	21	0,00
							$ 145	$ 373	$ 518	0,07

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	AUD	395	$	267	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	01/2023	HUF	83 016		212	0	(9)	(9)	0,00
	01/2023	¥	7 021 000		49 180	0	(4 066)	(4 066)	(0,57)
	01/2023	PEN	11 836		3 051	7	(55)	(48)	(0,01)
	01/2023	$	356	CHF	337	8	0	8	0,00
	01/2023		6 591	¥	869 000	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		2	THB	59	0	0	0	0,00
	02/2023		221	PEN	854	1	0	1	0,00
	03/2023	MYR	46 499	$	10 302	0	(370)	(370)	(0,05)
	03/2023	$	600	ZAR	10 590	19	0	19	0,00
	05/2023	CNH	14 174	$	2 191	121	0	121	0,02
BPS	01/2023	€	1 496		1 595	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	HUF	323 337		825	0	(37)	(37)	(0,01)
	01/2023	ILS	7 399		2 159	60	0	60	0,01
	01/2023	THB	25		1	0	0	0	0,00
	01/2023	TWD	39 022		1 275	3	0	3	0,00
	03/2023	CNH	12 279		1 902	118	0	118	0,02
	03/2023	MXN	22 408		1 112	0	(22)	(22)	0,00
	03/2023	MYR	110		24	0	(2)	(2)	0,00
	03/2023	TWD	8 006		266	3	0	3	0,00
	03/2023	$	4 746	MYR	20 965	66	0	66	0,01
	03/2023	ZAR	10 213	$	561	0	(35)	(35)	(0,01)
	05/2023	ILS	6 916		2 145	171	0	171	0,02
	05/2023	MYR	610		131	0	(10)	(10)	0,00
	07/2023	ILS	1 057		332	29	0	29	0,00
BRC	01/2023	CNH	4 112		590	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	HUF	935 913		2 441	0	(54)	(54)	(0,01)
	01/2023	PEN	1 157		291	0	(12)	(12)	0,00
	01/2023	SGD	956		710	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	$	6 643	MYR	31 361	530	0	530	0,07
	01/2023		6 241	NOK	62 103	65	0	65	0,01
	01/2023		113	THB	3 912	0	0	0	0,00
	02/2023	TWD	84 029	$	2 734	0	(14)	(14)	0,00
CBK	01/2023	AUD	637		428	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	DKK	3 365		474	0	(9)	(9)	0,00
	01/2023	€	1 228		1 300	0	(11)	(11)	0,00
	01/2023	ILS	10 998		3 481	364	0	364	0,05
	01/2023	PEN	7 254		1 806	0	(92)	(92)	(0,01)
	01/2023	THB	106 577		3 082	0	0	0	0,00
	01/2023	$	1 629	AUD	2 415	9	0	9	0,00
	01/2023		2 742	BRL	14 393	0	(16)	(16)	0,00
	01/2023		3 228	CHF	3 049	70	0	70	0,01
	01/2023		558	CLP	485 552	11	0	11	0,00
	01/2023		1 433	€	1 356	15	0	15	0,00
	01/2023		5 115	¥	680 300	44	0	44	0,01
	01/2023		664	NOK	6 582	4	0	4	0,00
	01/2023		3 049	NZD	4 771	0	(32)	(32)	(0,01)
	01/2023		1 765	PEN	6 833	26	0	26	0,00
	01/2023		523	THB	18 151	2	0	2	0,00
	02/2023		875	BRL	4 720	15	0	15	0,00
	03/2023	ILS	25 388	$	7 487	270	0	270	0,04
	03/2023	PEN	8 248		2 052	0	(99)	(99)	(0,01)
	03/2023	$	11	MXN	214	0	0	0	0,00
	04/2023	CLP	491 843	$	557	0	(11)	(11)	0,00
	04/2023	PEN	8 535		2 118	0	(101)	(101)	(0,01)

Tableau des investissements Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	05/2023	CNH	1 559	$	241	$ 13	$ 0	$ 13	0,00
	05/2023	PEN	15 097		3 836	0	(81)	(81)	(0,01)
	05/2023	$	2 107	CNH	14 857	63	0	63	0,01
	07/2023	ILS	6 406	$	1 894	55	0	55	0,01
	11/2023		10 830		3 236	104	0	104	0,01
CLY	01/2023	HUF	177 834		463	0	(11)	(11)	0,00
DUB	01/2023	DKK	68 092		9 597	0	(180)	(180)	(0,03)
	01/2023	HUF	10 493		23	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	TWD	15 741		514	1	0	1	0,00
	07/2023	ILS	7 554		2 157	0	(12)	(12)	0,00
GLM	01/2023	BRL	14 393		2 701	0	(25)	(25)	0,00
	01/2023	CLP	481 994		489	0	(76)	(76)	(0,01)
	01/2023	CNH	4 268		614	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	KRW	291 229		221	0	(10)	(10)	0,00
	01/2023	MYR	8 887		2 036	5	(2)	3	0,00
	01/2023	PEN	577		149	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	THB	11 621		333	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	$	2 060	MYR	9 111	24	0	24	0,00
	03/2023	CNH	6 354	$	984	61	0	61	0,01
	03/2023	$	949	MXN	19 514	38	0	38	0,01
	04/2023		2 653	BRL	14 393	26	0	26	0,00
	05/2023		1 712	PEN	6 812	55	0	55	0,01
IND	05/2023	CNH	22 540	$	3 485	193	0	193	0,03
JPM	01/2023	£	44 330		53 529	197	0	197	0,03
	01/2023	HUF	16		0	0	0	0	0,00
	01/2023	THB	9 861		286	1	0	1	0,00
	01/2023	$	387	THB	13 417	1	0	1	0,00
	02/2023	TWD	10 178	$	335	3	0	3	0,00
	03/2023	$	37	IDR	582 010	0	0	0	0,00
	05/2023		2	CNH	15	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	AUD	1 719	$	1 153	0	(12)	(12)	0,00
	01/2023	CAD	7 663		5 712	57	0	57	0,01
	01/2023	DKK	61 775		8 726	0	(144)	(144)	(0,02)
	01/2023	€	144 296		151 315	0	(2 750)	(2 750)	(0,39)
	01/2023	£	2 208		2 692	35	0	35	0,01
	01/2023	¥	1 121 104		8 160	0	(342)	(342)	(0,05)
	01/2023	NOK	4 180		422	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$	637	€	597	0	0	0	0,00
	01/2023		808	£	660	0	(14)	(14)	0,00
	01/2023		12 173	¥	1 620 100	114	0	114	0,02
	01/2023		295	KRW	381 621	8	0	8	0,00
	01/2023		222	PEN	895	12	0	12	0,00
	01/2023		794	THB	27 511	2	0	2	0,00
	02/2023	¥	3 820 000	$	26 770	0	(2 326)	(2 326)	(0,33)
	03/2023	$	296	CLP	265 532	13	0	13	0,00
	03/2023		23	IDR	353 251	0	0	0	0,00
	03/2023		221	TWD	6 624	0	(4)	(4)	0,00
	05/2023	CNH	95 487	$	14 228	294	0	294	0,04
MYI	01/2023	AUD	17 530		11 772	0	(119)	(119)	(0,02)
	01/2023	¥	4 673 434		34 089	0	(1 355)	(1 355)	(0,19)
	01/2023	MYR	4 227		958	0	(9)	(9)	0,00
	01/2023	THB	1 271		37	0	0	0	0,00
	01/2023	$	1 367	€	1 300	21	0	21	0,00
	01/2023		1 143	MYR	5 410	94	0	94	0,01
	02/2023	TWD	18 817	$	617	3	0	3	0,00
	03/2023	$	32	IDR	497 731	0	0	0	0,00
RBC	01/2023	AUD	202	$	135	0	(2)	(2)	0,00
	03/2023	$	57	MXN	1 142	1	0	1	0,00
RYL	01/2023	¥	9 000	$	66	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	$	108	HUF	40 806	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	AUD	1 175	$	792	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	KRW	20 799 945		15 741	0	(792)	(792)	(0,11)
	01/2023	NZD	14 460		9 007	0	(139)	(139)	(0,02)
	01/2023	TWD	109 754		3 489	0	(86)	(86)	(0,01)
	01/2023	$	242	CLP	241 038	40	0	40	0,01
	01/2023		953	€	900	8	0	8	0,00
	01/2023		957	MYR	4 227	10	0	10	0,00
	01/2023		416	PEN	1 602	3	0	3	0,00
	01/2023		206	THB	7 132	1	0	1	0,00
	03/2023	MYR	35 138	$	7 607	0	(458)	(458)	(0,06)
TOR	01/2023	¥	5 610 000		38 864	0	(3 740)	(3 740)	(0,52)
UAG	01/2023	CZK	1 677		66	0	(8)	(8)	0,00
	01/2023	HUF	586 069		1 492	0	(70)	(70)	(0,01)
	01/2023	$	510	DKK	3 565	2	0	2	0,00
	02/2023	¥	840 000	$	5 977	0	(430)	(430)	(0,06)
	02/2023	TWD	860		28	0	0	0	0,00
	03/2023	¥	350 019		2 559	0	(115)	(115)	(0,02)
						$ 3 589	$ (18 410)	$ (14 821)	(2,07)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$ 10 394	€ 9 749	$ 15	$ 0	$ 15	0,00
BPS	01/2023	€ 260	$ 277	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 18	€ 16	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	10 948	10 560	327	0	327	0,05
JPM	01/2023	1 618	1 556	43	0	43	0,01
MBC	01/2023	€ 26	$ 28	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 12 725	€ 12 142	239	0	239	0,03
SCX	01/2023	12 665	12 168	327	0	327	0,05
				$ 951	$ 0	$ 951	0,14

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en USD (exposition au risque de change) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 59	CHF 56	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	01/2023	303	MXN 5 932	2	0	2	0,00
	01/2023	247	SGD 339	6	0	6	0,00
BOM	01/2023	1 030	CAD 1 383	0	(9)	(9)	0,00
BPS	01/2023	€ 253	$ 270	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 18	SGD 25	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	£ 43	$ 52	0	0	0	0,00
	01/2023	PEN 278	72	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 105	NOK 1 046	1	0	1	0,00
	01/2023	437	SEK 4 581	2	0	2	0,00
	02/2023	72	PEN 278	1	0	1	0,00
CBK	01/2023	CNY 359	$ 51	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	€ 122	129	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	MXN 5 932	305	1	0	1	0,00
	01/2023	TWD 484	16	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 495	CHF 467	11	0	11	0,00
	01/2023	247	CNY 1 720	2	0	2	0,00
	01/2023	443	IDR 6 974 132	9	0	9	0,00
	01/2023	10	SEK 105	0	0	0	0,00
	02/2023	303	MXN 5 932	0	(1)	(1)	0,00
GLM	01/2023	MYR 1 853	$ 419	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 148	CZK 3 483	6	0	6	0,00
	01/2023	394	MYR 1 853	26	0	26	0,00
	01/2023	72	PEN 278	1	0	1	0,00
	01/2023	180	PLN 817	7	0	7	0,00
	02/2023	420	MYR 1 853	4	0	4	0,00
MBC	01/2023	€ 43	$ 46	0	0	0	0,00
	01/2023	¥ 20 645	155	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$ 112	AUD 165	0	0	0	0,00
	01/2023	64	CAD 86	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	1	CZK 16	0	0	0	0,00
	01/2023	217	DKK 1 552	6	0	6	0,00
	01/2023	21 173	€ 20 202	397	0	397	0,06
	01/2023	174	£ 143	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	190	ILS 651	0	(6)	(6)	0,00
	01/2023	2 566	¥ 352 891	111	0	111	0,02
	01/2023	11	NOK 112	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	1 435	AUD 2 137	14	0	14	0,00
	01/2023	11 486	¥ 1 574 720	457	0	457	0,06
RBC	01/2023	CAD 46	$ 34	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 17	AUD 25	0	0	0	0,00
	01/2023	5	KRW 5 962	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	CNY 741	$ 107	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	¥ 9 845	73	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 97	AUD 143	1	0	1	0,00
	01/2023	898	CAD 1 207	0	(8)	(8)	0,00
	01/2023	9 703	CNY 69 261	324	0	324	0,05
	01/2023	3 818	€ 3 669	99	0	99	0,01
	01/2023	194	NZD 312	3	0	3	0,00
TOR	01/2023	1 250	CAD 1 681	0	(10)	(10)	0,00
	01/2023	4 622	£ 3 844	3	0	3	0,00
UAG	01/2023	CLP 38 151	$ 44	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 40	CLP 38 151	5	0	5	0,00
	01/2023	98	HUF 38 974	5	0	5	0,00
	01/2023	0	IDR 5 386	0	0	0	0,00
	01/2023	1 215	KRW 1 594 214	52	0	52	0,01
	01/2023	28	SEK 292	0	0	0	0,00
	01/2023	368	THB 12 951	6	0	6	0,00
	02/2023	44	CLP 38 151	1	0	1	0,00
				$ 1 564	$ (46)	$ 1 518	0,21
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						**$ (13 011)**	**(1,82)**

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	% DE L'ACTIF NET
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
2,000 % éch. 01/01/2038	$ 13 300	$ (11 831)	(1,65)
2,000 % éch. 01/01/2053	75 650	(61 574)	(8,60)
2,500 % éch. 01/01/2053	3 300	(2 795)	(0,39)
Total des Titres vendus à découvert		**$ (76 200)**	**(10,64)**
Total des Investissements		**$ 682 087**	**95,26**
Autres actifs et passifs à court terme		**$ 33 935**	**4,74**
Actif net		**$ 716 022**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(e) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

(f) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(g) Affilié au Fonds.

(h) Titre convertible conditionnel.

(j) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 1,00 %) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Citigroup, Inc.	3,290 %	17/03/2026	10/03/2022	$ 2 200	$ 2 093	0,29
Deutsche Bank AG	3,729	14/01/2032	22/01/2021	301	221	0,03
Oracle Corp.	2,300	25/03/2028	22/03/2021	2 395	2 083	0,29
Oracle Corp.	2,875	25/03/2031	22/03/2021	599	499	0,07
Oracle Corp.	3,950	25/03/2051	22/03/2021	100	72	0,01
Oracle Corp.	4,100	25/03/2061	22/03/2021	699	489	0,07
				$ 6 294	$ 5 457	0,76

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 98 740 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 8 463 $) ont été nantis ou livrés en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 25 647 $ (31 décembre 2021 : 15 571 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 12 800 $ (31 décembre 2021 : 3 640 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 737 412	$ 0	$ 737 412
Fonds d'investissement	46 863	459	0	47 322
Contrats de mise en pension	0	1 625	0	1 625
Instruments financiers dérivés[3]	1 705	(29 777)	0	(28 072)
Titres vendus à découvert	0	(76 200)	0	(76 200)
Totaux	**$ 48 568**	**$ 633 519**	**$ 0**	**$ 682 087**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 1 081 382	$ 0	$ 1 081 382
Fonds d'investissement	6 361	0	0	6 361
Contrats de mise en pension	0	1 246	0	1 246
Instruments financiers dérivés[3]	1 470	(10 441)	0	(8 971)
Titres vendus à découvert	0	(150 627)	0	(150 627)
Totaux	**$ 7 831**	**$ 921 560**	**$ 0**	**$ 929 391**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ 27	$ 0	$ 27	$ (2)	$ 0	$ (2)
BOA	(4 371)	3 760	(611)	68	(220)	(152)
BOM	(9)	0	(9)	S/O	S/O	S/O
BPS	633	(530)	103	(1 454)	1 130	(324)
BRC	488	(400)	88	360	(270)	90
CBK	979	(680)	299	(277)	270	(7)
CLY	(11)	0	(11)	S/O	S/O	S/O
CIB	S/O	S/O	S/O	1	0	1
DUB	(252)	280	28	(370)	0	(370)
GLM	(593)	420	(173)	(454)	560	106
GSC	S/O	S/O	S/O	(2)	0	(2)
GST	(35)	0	(35)	(10)	0	(10)
HUS	(5)	0	(5)	(572)	260	(312)
IND	193	(330)	(137)	S/O	S/O	S/O
JPM	165	0	165	(304)	20	(284)
MBC	(4 349)	3 720	(629)	S/O	S/O	S/O
MYC	15	10	25	(68)	(740)	(808)
MYI	(894)	490	(404)	540	(730)	(190)
NAB	S/O	S/O	S/O	(22)	0	(22)
RBC	(1)	0	(1)	90	0	90
RYL	(3)	0	(3)	(559)	460	(99)
SCX	(688)	600	(88)	(1 205)	930	(275)
TOR	(3 747)	3 130	(617)	219	(280)	(61)
UAG	(553)	390	(163)	221	0	221
WST	S/O	S/O	S/O	(4)	0	(4)

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	51,35	92,15
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	51,26	26,23
Autres valeurs mobilières	0,37	0,22
Fonds d'investissement	6,61	0,70
Contrats de mise en pension	0,23	0,14
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,23	0,21
Instruments financiers dérivés compensés	(2,33)	(0,77)
Instruments financiers dérivés hors cote	(1,82)	(0,42)
Titres vendus à découvert	(10,64)	(16,52)
Contrats de prise en pension	S/O	(10,91)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	S/O	(0,93)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Australie	1,91	2,63
Brésil	0,21	0,17
Canada	1,68	2,18
Îles Caïmans	2,86	3,57
Chine	2,16	13,05
Danemark	2,57	4,33
Finlande	S/O	0,08

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
France	3,25	4,03
Allemagne	2,47	2,36
Guernesey, Îles Anglo-normandes	S/O	0,04
Hong Kong	0,08	0,13
Hongrie	0,03	0,06
Inde	S/O	0,17
Irlande	6,51	5,22
Israël	1,22	1,13
Italie	1,29	4,31
Japon	4,87	17,80
Jersey, Îles Anglo-normandes	S/O	0,03
Luxembourg	0,71	0,84
Malaisie	0,92	1,94
Mexique	0,04	0,05
Multinationales	0,11	0,11
Pays-Bas	0,77	1,66
Nouvelle-Zélande	0,09	0,09
Norvège	0,22	0,08
Pérou	1,21	1,12
Pologne	0,03	S/O
Portugal	0,14	0,02
Qatar	0,05	0,28
Roumanie	0,55	0,47
Russie	S/O	0,28
Arabie saoudite	S/O	0,79
Serbie	0,26	0,30
Singapour	S/O	0,90
Slovénie	0,22	0,33
Afrique du Sud	S/O	0,08
Corée du Sud	2,27	2,11
Espagne	1,50	4,43
Supranationales	0,51	0,41
Suède	0,09	0,11
Suisse	0,95	1,76
Thaïlande	0,51	S/O
Émirats arabes unis	0,07	0,20
Royaume-Uni	9,28	12,91
États-Unis	30,13	24,99
Instruments à court terme	21,24	1,05
Fonds d'investissement	6,61	0,70
Contrats de mise en pension	0,23	0,14
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,24	0,21
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,01)	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,02)	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection	(0,13)	(0,04)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	S/O	0,00
Swaps de taux d'intérêt - Swaps de base	0,01	0,01
Swaps de taux d'intérêt	(2,19)	(0,74)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,05	0,01
Options sur titres	0,09	0,02
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Options de change	S/O	(0,01)
Swaptions de taux d'intérêt	(0,28)	(0,16)
Options à taux d'intérêt plafonnées	S/O	0,00
Options sur titres	S/O	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	(0,01)	(0,03)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,00
Swaps sur devises croisées	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(0,02)	0,01
Swaps de rendement total sur indices	0,07	0,01
Swaps de rendement total sur titres	S/O	0,00
Contrats de change à terme	(2,07)	(0,34)
Contrats de change à terme couverts	0,35	0,07
Titres vendus à découvert	(10,64)	(16,52)
Autres actifs et passifs à court terme	4,74	(1,94)
Actif net	100,00	100,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
BANQUE ET FINANCE			
Avolon Holdings Funding Ltd.			
2,528 % éch. 18/11/2027	$ 216	$ 173	0,02
Bank of America Corp.			
5,875 % éch. 15/03/2028 (f)	650	576	0,08
DAE Sukuk Difc Ltd.			
3,750 % éch. 15/02/2026	700	666	0,09
Ford Motor Credit Co. LLC			
3,810 % éch. 09/01/2024	200	195	0,03
5,584 % éch. 18/03/2024	600	593	0,08
Kaisa Group Holdings Ltd.			
9,375 % éch. 30/06/2024 ^	650	91	0,01
9,750 % éch. 28/09/2023 ^	1 100	155	0,02
11,700 % éch. 11/11/2025 ^	250	35	0,01
Nissan Motor Acceptance Co. LLC			
1,850 % éch. 16/09/2026	300	251	0,03
Sunac China Holdings Ltd.			
8,350 % éch. 19/04/2023 ^	800	177	0,02
UniCredit SpA			
7,830 % éch. 04/12/2023	7 350	7 428	0,99
Ursa Re Ltd.			
8,277 % éch. 07/12/2027	1 150	1 130	0,15
VICI Properties LP			
3,875 % éch. 15/02/2029	800	702	0,09
Yango Justice International Ltd.			
7,500 % éch. 15/04/2024 ^	1 300	48	0,01
		12 220	1,63
INDUSTRIE			
American Airlines Pass-Through Trust			
3,575 % éch. 15/07/2029	429	383	0,05
Berry Global, Inc.			
4,875 % éch. 15/07/2026	4 500	4 343	0,58
DAE Funding LLC			
1,625 % éch. 15/02/2024	400	380	0,05
Energy Transfer LP			
3,750 % éch. 15/05/2030	2 100	1 856	0,25
Las Vegas Sands Corp.			
3,200 % éch. 08/08/2024	200	189	0,03
Nissan Motor Co. Ltd.			
4,345 % éch. 17/09/2027	100	91	0,01
4,810 % éch. 17/09/2030	2 100	1 787	0,24
		9 029	1,21
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS			
Midwest Connector Capital Co. LLC			
3,900 % éch. 01/04/2024	3 400	3 294	0,44
Pacific Gas & Electric Co.			
2,500 % éch. 01/02/2031	1 100	856	0,11
		4 150	0,55
Total des Obligations et billets privés		25 399	3,39
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES			
Multiplan Corp. (6,000 % en numéraire ou 7,000 % de rémunération en nature)			
6,000 % éch. 15/10/2027 (b)	1 400	900	0,12
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Fannie Mae			
2,191 % éch. 25/03/2036 (a)	130	12	0,00
Freddie Mac			
1,280 % éch. 15/05/2035	176	154	0,02
1,782 % éch. 15/08/2043 (a)	367	65	0,01
Ginnie Mae			
3,600 % éch. 20/09/2071	7 003	6 913	0,92
3,858 % éch. 20/08/2068	832	810	0,11
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
2,000 % éch. 01/01/2053	13 000	10 581	1,41
2,500 % éch. 01/01/2053	8 200	6 945	0,93
3,000 % éch. 01/02/2053	4 900	4 305	0,57
3,500 % éch. 01/02/2053	6 600	6 001	0,80
		35 786	4,77

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Obligations du Trésor américain			
1,375 % éch. 15/11/2040	$ 5 700	$ 3 709	0,49
4,000 % éch. 15/11/2042	3 040	2 977	0,40
4,000 % éch. 15/11/2052	2 290	2 294	0,31
		8 980	1,20
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
3,474 % éch. 25/07/2036 ^	99	87	0,01
3,845 % éch. 25/02/2036 ^	38	34	0,01
Bear Stearns Mortgage Funding Trust			
4,689 % éch. 25/04/2037	1 506	1 297	0,17
Countrywide Alternative Loan Trust			
4,689 % éch. 25/07/2035	962	767	0,10
4,709 % éch. 25/09/2047	202	174	0,02
6,000 % éch. 25/04/2037	786	667	0,09
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
5,009 % éch. 25/04/2035	122	101	0,01
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust			
6,000 % éch. 25/02/2037 ^	45	19	0,00
HomeBanc Mortgage Trust			
5,249 % éch. 25/08/2029	393	372	0,05
Impac CMB Trust			
5,009 % éch. 25/04/2035	193	177	0,02
5,034 % éch. 25/04/2035	248	226	0,03
IndyMac Mortgage Loan Trust			
4,549 % éch. 25/04/2037	1 875	1 576	0,21
4,949 % éch. 25/07/2035	96	70	0,01
Lehman XS Trust			
4,789 % éch. 25/08/2046	1 204	1 077	0,14
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			
4,869 % éch. 25/05/2037	586	259	0,04
Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
4,909 % éch. 25/06/2046	1 259	306	0,04
6,000 % éch. 25/12/2036	320	253	0,04
Structured Asset Mortgage Investments Trust			
4,539 % éch. 25/02/2037	372	327	0,04
Towd Point Mortgage Funding PLC			
4,071 % éch. 20/10/2051	£ 1 426	1 706	0,23
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
5,049 % éch. 25/01/2045	$ 2 162	1 965	0,26
5,189 % éch. 25/01/2045	612	557	0,08
5,309 % éch. 25/10/2044	96	87	0,01
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
6,000 % éch. 25/07/2036	478	328	0,05
		12 432	1,66
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS			
Aames Mortgage Investment Trust			
4,869 % éch. 25/04/2036	87	78	0,01
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
4,869 % éch. 25/06/2036	272	198	0,03
5,289 % éch. 25/08/2035	284	271	0,04
5,514 % éch. 25/04/2035	157	132	0,02
6,189 % éch. 25/06/2034	18	19	0,00
Aegis Asset-Backed Securities Trust			
5,034 % éch. 25/12/2035	480	450	0,06
Apidos CLO			
5,009 % éch. 17/07/2030	300	297	0,04
5,253 % éch. 20/04/2031	950	936	0,12
Ares European CLO DAC			
2,306 % éch. 20/04/2032	€ 300	311	0,04
Argent Securities Trust			
4,689 % éch. 25/07/2036	$ 1 161	1 004	0,13
4,709 % éch. 25/05/2036	403	102	0,01
Asset-Backed Funding Certificates Trust			
4,529 % éch. 25/10/2036	150	136	0,02
5,089 % éch. 25/06/2034	587	551	0,07
5,124 % éch. 25/03/2035	626	566	0,08
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
3,658 % éch. 25/12/2036	770	742	0,10
Atlas Senior Loan Fund Ltd.			
5,480 % éch. 17/11/2027	323	320	0,04

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Barings CLO Ltd.			
5,043 % éch. 20/01/2028	$ 263	$ 262	0,03
Cairn CLO DAC			
2,253 % éch. 25/04/2032	€ 200	208	0,03
2,688 % éch. 20/10/2028	97	101	0,01
Catamaran CLO Ltd.			
5,425 % éch. 22/04/2030	$ 1 293	1 275	0,17
Centex Home Equity Loan Trust			
5,439 % éch. 25/10/2035	993	947	0,13
CIT Mortgage Loan Trust			
5,739 % éch. 25/10/2037	534	532	0,07
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
4,824 % éch. 25/11/2036	166	163	0,02
5,289 % éch. 25/01/2036	985	943	0,13
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
3,694 % éch. 25/12/2034	1 734	1 686	0,22
4,619 % éch. 25/05/2037	9 914	9 333	1,24
4,649 % éch. 25/12/2036 ^	211	193	0,03
6,339 % éch. 25/08/2035	750	675	0,09
Ellington Loan Acquisition Trust			
5,489 % éch. 25/05/2037	233	223	0,03
First Franklin Mortgage Loan Trust			
4,509 % éch. 25/11/2036	649	598	0,08
5,094 % éch. 25/11/2036	2 031	1 937	0,26
5,289 % éch. 25/07/2035	1 563	1 530	0,20
5,334 % éch. 25/06/2034	740	690	0,09
Fremont Home Loan Trust			
4,539 % éch. 25/10/2036	6 628	2 803	0,37
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC			
2,356 % éch. 20/01/2032	€ 300	310	0,04
GSAMP Trust			
5,064 % éch. 25/11/2035	$ 450	422	0,06
Harvest CLO DAC			
2,228 % éch. 15/01/2032	€ 800	827	0,11
2,433 % éch. 18/11/2029	197	207	0,03
Home Equity Asset Trust			
3,826 % éch. 25/02/2036	$ 3 164	3 044	0,41
Invesco Euro CLO DAC			
2,028 % éch. 15/07/2031	€ 500	518	0,07
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
3,919 % éch. 25/03/2047	$ 1 240	790	0,11
4,599 % éch. 25/10/2036	56	55	0,01
4,689 % éch. 25/03/2037	1 000	937	0,13
Jubilee CLO DAC			
2,846 % éch. 15/12/2029	€ 224	235	0,03
Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust			
7,170 % éch. 15/04/2040 ^	$ 805	567	0,08
Long Beach Mortgage Loan Trust			
4,989 % éch. 25/01/2036	2 310	2 068	0,28
5,664 % éch. 25/02/2035	540	529	0,07
Man GLG Euro CLO DAC			
2,248 % éch. 15/01/2030	€ 229	239	0,03
MASTR Asset-Backed Securities Trust			
4,599 % éch. 25/05/2037	$ 792	747	0,10
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
5,319 % éch. 25/07/2035	677	655	0,09
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
4,499 % éch. 25/03/2037	1 380	623	0,08
4,519 % éch. 25/10/2036	85	75	0,01
4,529 % éch. 25/10/2036	1 097	527	0,07
4,689 % éch. 25/06/2036	259	226	0,03
5,639 % éch. 25/07/2037	800	666	0,09
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd.			
5,283 % éch. 20/04/2031	250	246	0,03
OCP Euro CLO DAC			
2,198 % éch. 15/01/2032	€ 1 087	1 139	0,15
2,382 % éch. 22/09/2034	1 100	1 141	0,15
Option One Mortgage Loan Trust			
5,124 % éch. 25/05/2035	$ 500	463	0,06
5,259 % éch. 25/05/2035	1 151	932	0,12
OZLM Ltd.			
5,393 % éch. 20/01/2031	300	295	0,04
Palmer Square European Loan Funding DAC			
2,098 % éch. 15/10/2031	€ 2 151	2 227	0,30
2,158 % éch. 15/04/2031	683	709	0,09
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust			
4,884 % éch. 25/07/2036	$ 287	268	0,04

Tableau des Investissements Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Residential Asset Mortgage Products Trust				
4,739 % éch. 25/10/2036	$	567	$ 527	0,07
Residential Asset Securities Corp. Trust				
4,187 % éch. 25/11/2036 ^		3 102	2 699	0,36
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
4,739 % éch. 25/05/2037		133	101	0,01
5,169 % éch. 25/02/2034		304	292	0,04
Segovia European CLO DAC				
2,336 % éch. 20/07/2032	€	700	723	0,10
Sound Point CLO Ltd.				
5,344 % éch. 18/04/2031	$	800	783	0,10
Structured Asset Investment Loan Trust				
5,009 % éch. 25/01/2036		453	406	0,05
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
4,959 % éch. 25/10/2036		214	209	0,03
5,184 % éch. 25/02/2036		200	184	0,02
5,394 % éch. 25/11/2035		1 000	980	0,13
Toro European CLO DAC				
2,239 % éch. 12/01/2032	€	300	308	0,04
Venture CLO Ltd.				
4,959 % éch. 15/07/2027	$	53	53	0,01
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust				
4,699 % éch. 25/08/2036		547	510	0,07
			59 674	7,95
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement argentin				
0,500 % éch. 09/07/2030		994	230	0,03
1,500 % éch. 09/07/2035		653	148	0,02
Obligations du Trésor argentin BONCER				
1,400 % éch. 25/03/2023	ARS	60 319	183	0,02
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos				
4,700 % éch. 01/09/2030	CLP	5 200 000	5 891	0,78
Obligation du gouvernement chinois				
3,280 % éch. 03/12/2027	CNY	139 660	20 703	2,76
TES colombien				
7,000 % éch. 26/03/2031	COP	5 601 800	814	0,11
7,750 % éch. 18/09/2030		39 400 000	6 127	0,82
Obligation internationale du gouvernement japonais				
0,100 % éch. 01/03/2023	¥	308 000	2 335	0,31
1,700 % éch. 20/09/2044		600 000	4 847	0,65
Obligation internationale du gouvernement péruvien				
1,862 % éch. 01/12/2032	$	1 800	1 317	0,18
Obligation internationale du gouvernement qatari				
3,875 % éch. 23/04/2023		2 000	1 992	0,27
Obligation internationale du gouvernement sud-africain				
10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	152 100	9 451	1,26
Obligation internationale du gouvernement espagnol				
0,700 % éch. 30/04/2032	€	5 000	4 150	0,55
Bon du Trésor britannique				
0,625 % éch. 22/10/2050	£	3 000	1 613	0,21
			59 801	7,97

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ACTIONS ORDINAIRES			
SERVICES DE COMMUNICATION			
Activision Blizzard, Inc.	4 698	360	0,05
TEGNA, Inc.	168 148	3 563	0,47
		3 923	0,52
ÉNERGIE			
Devon Energy Corp.	4 000	246	0,03
Exxon Mobil Corp.	3 800	419	0,06
		665	0,09
SERVICES FINANCIERS			
Credit Suisse Group AG	1	0	0,00
First Horizon Corp.	161 653	3 960	0,53
		3 960	0,53
SOINS DE SANTÉ			
AbbVie, Inc.	5 400	873	0,12
Elevance Health, Inc.	4 621	$ 2 370	0,32
Exact Sciences Corp. (c)	6 587	326	0,04
Exelixis, Inc. (c)	57 204	918	0,12
Halozyme Therapeutics, Inc. (c)	26 937	1 533	0,20
Hologic, Inc. (c)	17 523	1 311	0,17
Horizon Therapeutics PLC (c)	26 500	3 016	0,40
Humana, Inc.	4 401	2 254	0,30
Incyte Corp. (c)	16 530	1 328	0,18
LHC Group, Inc. (c)	22 910	3 704	0,49
Merck & Co., Inc.	3 742	415	0,06
Molina Healthcare, Inc. (c)	1 792	592	0,08
Neurocrine Biosciences, Inc. (c)	3 543	423	0,06
Pfizer, Inc. (c)	18 100	927	0,12
Regeneron Pharmaceuticals, Inc. (c)	3 435	2 478	0,33
Seagen, Inc. (c)	4 534	583	0,08
United Therapeutics Corp. (c)	5 001	1 391	0,19
Vertex Pharmaceuticals, Inc. (c)	7 913	2 285	0,30
		26 727	3,56
INDUSTRIE			
ABB Ltd.	28 267	861	0,12
Accelleron Industries AG (c)	1 413	29	0,00
AMETEK, Inc.	16 956	2 369	0,32
Eaton Corp. PLC	10 206	1 602	0,21
Emerson Electric Co.	16 145	1 551	0,21
FANUC Corp.	3 242	483	0,06
MasTec, Inc. (c)	17 777	1 517	0,20
Mueller Water Products, Inc. « A »	142 508	1 533	0,21
		9 945	1,33
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION			
Flex Ltd. (c)	51 395	1 103	0,15
NetApp, Inc.	26 589	1 597	0,21
Zebra Technologies Corp. « A » (c)	1 000	256	0,04
		2 956	0,40
MATÉRIAUX			
CF Industries Holdings, Inc.	5 100	434	0,05
Mosaic Co.	6 500	285	0,04
Nutrien Ltd.	3 900	285	0,04
		1 004	0,13
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS			
PNM Resources, Inc.	49 758	2 428	0,32
		51 608	6,88
TITRES PRIVILÉGIÉS			
Nationwide Building Society 10,250 %	8 144	1 227	0,16
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT IMMOBILIER			
Agree Realty Corp.	41 327	2 931	0,39
American Tower Corp.	9 856	2 088	0,28
Apartment Income REIT Corp.	62 213	2 135	0,28
Equinix, Inc.	2 871	1 881	0,25
Equity LifeStyle Properties, Inc.	30 425	1 965	0,26
Equity Residential	39 817	2 349	0,31
First Industrial Realty Trust, Inc.	62 470	3 015	0,40
Gaming and Leisure Properties, Inc.	48 445	2 523	0,34
Host Hotels & Resorts, Inc.	135 801	2 180	0,29
Invitation Homes, Inc.	104 896	3 109	0,41
Life Storage, Inc.	10 431	$ 1 027	0,14
National Storage Affiliates Trust	25 381	917	0,12
Prologis, Inc.	42 264	4 764	0,64
Public Storage	4 700	1 317	0,18
RLJ Lodging Trust	138 744	1 469	0,20
SBA Communications Corp.	9 092	2 549	0,34
Simon Property Group, Inc.	22 810	2 680	0,36
Sun Communities, Inc.	13 938	1 993	0,27
Sunstone Hotel Investors, Inc.	56 900	550	0,07
VICI Properties, Inc.	77 162	2 500	0,33
		43 942	5,86

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BONS DU TRÉSOR HONGROIS				
18,250 % éch. 03/01/2023 (d)(e)	HUF	2 514 000	6 700	0,89
BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN				
0,011 % éch. 04/01/2023 (d)(e)	ILS	4 200	1 190	0,16
0,022 % éch. 04/01/2023 (d)(e)		13 100	3 711	0,50
0,156 % éch. 04/01/2023 (d)(e)		600	170	0,02
1,716 % éch. 05/07/2023 (d)(e)		11 900	3 310	0,44
1,718 % éch. 03/05/2023 (d)(e)		600	168	0,02
1,734 % éch. 05/07/2023 (d)(e)		4 700	1 307	0,17
1,755 % éch. 05/07/2023 (d)(e)		2 300	640	0,09
1,783 % éch. 03/05/2023 (d)(e)		1 900	532	0,07
1,837 % éch. 02/08/2023 (d)(e)		10 500	2 913	0,39
			13 941	1,86
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS				
(0,249) % éch. 11/01/2023 (d)(e)	¥	9 000	68	0,01
(0,244) % éch. 11/01/2023 (d)(e)		8 378 000	63 499	8,48
(0,242) % éch. 23/01/2023 (d)(e)		72 000	546	0,07
(0,159) % éch. 23/01/2023 (d)(e)		1 090 000	8 262	1,10
(0,138) % éch. 06/03/2023 (d)(e)		2 521 000	19 112	2,55
(0,124) % échéance 27/02/2023 (d)(e)		4 803 000	36 412	4,86
(0,117) % échéance 27/02/2023 (d)(e)		3 317 000	25 146	3,35
			153 045	20,42
Total des Instruments à court terme			173 686	23,17
Total des Valeurs mobilières			**$ 473 435**	**63,13**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	15 191 336	151 214	20,16
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)	1 012 212	100 275	13,37
Total des Fonds d'investissement		**$ 251 489**	**33,53**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BPS	4,310 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 7 300	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % échéance 15/02/2050	$ (7 418)	$ 7 300	$ 7 303	0,97
FICC	1,900	30/12/2022	03/01/2023	11 236	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 29/12/2023	(11 461)	11 236	11 237	1,50
Total des Contrats de mise en pension						**$ (18 879)**	**$ 18 536**	**$ 18 540**	**2,47**

[1] Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans mars	Long	03/2023	74	$ (71)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars	Long	03/2023	15	(65)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Indice CAC 40 Index janvier	Long	01/2023	30	(57)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars	Long	03/2023	44	(68)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Indice DAX Index mars	Long	03/2023	3	(32)	0,00
Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini S&P 500 Index mars	Long	03/2023	1 338	(9 881)	(1,32)
Contrats à terme standardisés sur Euro STOXX 50 mars	Court	03/2023	258	471	0,06
Contrats à terme standardisés sur Euro STOXX 600 mars	Long	03/2023	3 068	(2 635)	(0,35)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Long	03/2023	103	(469)	(0,06)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	Long	03/2023	65	(561)	(0,07)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	214	1	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	Long	03/2023	6	(164)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars	Court	03/2023	31	293	0,04
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars	Long	03/2023	151	(225)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE 100 Index mars	Long	03/2023	20	3	0,00
Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE/MIB Index mars	Court	03/2023	3	10	0,00
Contrats à terme standardisés sur IBEX 35 janvier	Long	01/2023	1	0	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Long	03/2023	25	(521)	(0,07)
Contrats à terme standardisés sur Indice Mini MSCI Emerging Markets Index mars	Long	03/2023	322	(365)	(0,05)
Contrats à terme standardisés sur Nikkei 225 libellé en yen mars	Long	03/2023	6	(43)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Indice OMXS30 Index janvier	Court	01/2023	1	1	0,00
Contrats à terme standardisés sur S&P/Toronto Stock Exchange 60 mars	Long	03/2023	84	(500)	(0,07)
Contrats à terme standardisés sur Indice SPI 200 Index mars	Long	03/2023	114	(254)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur Swiss Market mars	Court	03/2023	1	3	0,00
Contrats à terme standardisés sur Indice Topix Index mars	Long	03/2023	136	(556)	(0,07)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Long	03/2023	82	(1)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Court	03/2023	239	(4)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	83	(70)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Long	03/2023	169	(218)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Long	03/2023	15	(1)	0,00
				$ (15 979)	(2,13)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ (15 979)**	**(2,13)**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AT&T, Inc.	1,000 %	20/06/2026	$ 200	$ (3)	0,00
General Motors Co.	5,000	20/12/2026	300	(27)	(0,01)
				$ (30)	(0,01)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION[2]

Indices/Tranches	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice iTraxx Crossover 37 à 5 ans	(5,000) %	20/06/2027	€ 100	$ 3	0,00

Tableau des Investissements Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (suite)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000 %	20/12/2027	$ 100	$ 5	0,00
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000	20/12/2027	49 800	512	0,07
Indice iTraxx Europe Main 37 à 5 ans	1,000	20/06/2027	€ 300	(3)	0,00
				$ 514	0,07

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000 %	15/03/2033	£ 4 500	$ 110	0,02
À recevoir[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053	1 700	(97)	(0,01)
À payer[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250	15/03/2028	1 900	(67)	(0,01)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,500	21/09/2027	INR 263 320	(13)	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2026	¥ 2 800 000	(271)	(0,04)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,050	15/12/2031	3 990 000	1 078	0,14
À payer[4]	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	1,000	15/03/2053	520 000	(57)	(0,01)
À recevoir	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/12/2026	SGD 9 630	(100)	(0,01)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	0,250	16/03/2024	$ 14 500	251	0,03
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2029	41 000	(1 734)	(0,23)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	14 300	571	0,08
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2052	3 100	249	0,03
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2052	4 000	-177	-0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,385	08/06/2032	6 100	517	0,07
À recevoir[4]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,700	03/11/2033	22 400	(565)	(0,07)
À payer[4]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	4,100	03/11/2025	97 300	677	0,09
À payer	CDI BRL à 1 an	11,575	04/01/2027	BRL 39 700	(11)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,670	02/01/2025	32 000	(113)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,708	02/01/2025	22 000	66	0,01
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,740	02/01/2025	42 700	124	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	11,750	02/01/2025	30 597	27	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,120	02/01/2025	69 900	(148)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,330	02/01/2025	84 800	(139)	(0,02)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,460	02/01/2025	14 600	17	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,250	21/09/2052	CAD 2 600	(209)	(0,03)
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,250	21/12/2027	CNY 57 300	0	0,00
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	15/12/2026	55 090	13	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,920	26/08/2026	COP 21 200 000	735	0,10
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,925	26/08/2026	20 900 000	(592)	(0,08)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,215	09/02/2027	38 418 830	47	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,620	18/09/2030	29 000 000	680	0,09
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,585	26/11/2025	21 088 900	233	0,03
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,590	26/11/2025	22 207 400	245	0,03
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,930	18/09/2030	2 700 000	26	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,280	26/11/2025	24 084 000	178	0,02
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,270	17/11/2027	16 699 000	21	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,840	02/12/2025	74 238 900	59	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,960	21/11/2025	11 115 900	(15)	0,00
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,215	11/02/2027	ILS 10 150	18	0,00
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	1,268	17/03/2031	KRW 2 741 200	(234)	(0,03)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	1,336	17/03/2031	1 600 000	(139)	(0,02)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	2,500	16/03/2027	495 400	(1)	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	5,980	21/12/2026	ZAR 151 000	135	0,02
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	6,690	04/11/2026	146 400	(328)	(0,04)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,850	14/01/2027	CLP 3 860 940	58	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,045	11/02/2027	3 472 700	81	0,01
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,225	29/07/2027	CZK 70 940	44	0,01
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,081	15/02/2031	€ 24 400	(3 300)	(0,44)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2025	2 700	(24)	0,00
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028	10 300	(495)	(0,07)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053	5 400	(294)	(0,04)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	22 140	(353)	(0,05)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	3,700	08/11/2026	HUF 3 299 700	577	0,08
À payer	BBR HUF à 6 mois	11,070	02/09/2027	450 700	(18)	0,00
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	2,983	08/11/2026	PLN 6 850	(44)	(0,01)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,745	11/02/2027	MXN 74 680	16	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,240	02/12/2032	64 700	110	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,250	01/12/2032	66 000	110	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,700	05/11/2027	63 500	(19)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,400	11/12/2024	246 000	(118)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,455	12/12/2024	240 300	(102)	(0,01)
					$ (2 704)	(0,36)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ (2 217)**	**(0,30)**

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS VENDUES

OPTIONS PLAFONNÉES SUR L'INFLATION

Contrepartie	Description	Indice initial	Taux variable	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	Taux plafond - CPALEMU hors cote	$ 100,151	Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 3,000 %] ou 0	22/06/2035	8 200	$ (374)	$ (416)	(0,06)
JPM	Taux plafond - CPURNSA hors cote	234,781	Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 4,000 %] ou 0	16/05/2024	1 500	(10)	0	0,00
						$ (384)	$ (416)	(0,06)

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000 %	19/01/2023	1 950	$ (9)	$ (1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,500	19/01/2023	1 950	(8)	(23)	(0,01)
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	4,140	05/01/2023	24 000	(32)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,640	05/01/2023	24 000	(32)	(4)	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	19/01/2023	1 950	(8)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,500	19/01/2023	1 950	(8)	(24)	0,00
							$ (97)	$ (54)	(0,01)

(1) Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17/11/2059	$ 2 900	$ (86)	$ 80	$ (6)	0,00
MYC	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	12 200	(403)	376	(27)	(0,01)
SAL	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	2 200	(5)	(13)	(18)	0,00
UAG	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	5 100	(148)	137	(11)	0,00
					$ (642)	$ 580	$ (62)	(0,01)

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	2,750 %	15/12/2026	MYR 6 350	$ (15)	$ (39)	$ (54)	(0,01)
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	3,000	16/03/2027	33 030	(123)	(101)	(224)	(0,03)
CBK	À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	1,430	01/07/2029	KRW 100	0	0	0	0,00
GLM	À payer	THBFIX THB à 6 mois	1,750	15/06/2027	THB 107 200	(77)	12	(65)	(0,01)
GST	À payer	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,500	21/09/2027	57 200	26	(3)	23	0,01
MYC	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	21/09/2027	7 800	1	(1)	0	0,00
						$ (188)	$ (132)	$ (320)	(0,04)

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

Contrepartie	À payer/à recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel	Date d'échéance	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	À payer	Indice Dow Jones U.S. Select REIT Total Return Index	229	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	$ 2 664	04/01/2023	$ 0	$ 150	$ 150	0,02
	À payer	Indice Dow Jones U.S. Select REIT Total Return Index	1 814	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	19 993	23/08/2023	0	81	81	0,01
BPS	À payer	Indice Dow Jones U.S. Select REIT Total Return Index	757	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	8 343	15/02/2023	0	33	33	0,01
	À payer	Indice Industrial Select Sector Index	2 419	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	8 537	21/06/2023	0	32	32	0,00
	À recevoir	Indice iBoxx USD Liquid Investment Grade Index	S/O	1,058 %	100	20/12/2023	(1)	(2)	(3)	0,00
BRC	À recevoir	Indice NDUEACWF Index	25 089	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	7 968	06/09/2023	0	(49)	(49)	(0,01)
GST	À recevoir	Indice iBoxx USD Liquid High Yield Index	S/O	1,058	100	20/06/2023	(1)	(1)	(2)	0,00
JPM	À payer	Indice JPPMGSHP Index	189 602	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	15 327	07/06/2023	0	39	39	0,01
	À payer	Indice NDUEACWF Index	78 972	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	25 082	06/09/2023	0	153	153	0,02
MBC	À recevoir	Indice MSCI Emerging Markets Index	24 335	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	11 828	06/12/2023	0	(33)	(33)	0,00
MEI	À payer	Indice SX4T Index	3 303	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	€ 9 771	11/01/2023	0	7	7	0,00
MYI	À recevoir	Indice MSCI Emerging Markets Index	24 335	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	$ 11 828	01/03/2023	0	(40)	(40)	(0,01)
	À recevoir	Indice MSCI Emerging Markets Index	24 335	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	11 828	08/03/2023	0	(41)	(41)	(0,01)
	À recevoir	Indice MSCI Emerging Markets Index	24 335	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	11 828	07/06/2023	0	(41)	(41)	(0,01)
SOG	À payer	Indice Dow Jones U.S. Select REIT Total Return Index	1 065	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	11 810	05/04/2023	0	118	118	0,02
							$ (2)	$ 406	$ 404	0,05

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

Contrepartie	À payer/à recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel	Date d'échéance	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	À payer	3M Co.	18 600	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	$ 2 243	28/06/2023	$ 0	$ 20	$ 20	0,00
	À payer	Fastenal Co.	34 800	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	1 655	28/06/2023	0	14	14	0,00
	À payer	Illinois Tool Works, Inc.	10 800	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	2 397	28/06/2023	0	12	12	0,00
	À payer	J.B. Hunt Transport, Inc.	5 500	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	972	28/06/2023	0	17	17	0,00
	À payer	Knight-Swift Transportation Holdings, Inc.	18 900	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	993	28/06/2023	0	6	6	0,00
	À payer	Old Dominion Freight Line, Inc.	3 400	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	974	28/06/2023	0	13	13	0,00
	À payer	W.W. Grainger, Inc.	4 500	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	2 530	28/06/2023	0	36	36	0,01
	À payer	Watsco, Inc.	8 600	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	2 172	28/06/2023	0	35	35	0,01
							$ 0	$ 153	$ 153	0,02

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£	111	$	135	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	01/2023	HUF	111 156		284	0	(12)	(12)	0,00
	01/2023	¥	8 512 800		59 611	0	(4 959)	(4 959)	(0,66)
	01/2023	PEN	6 302		1 581	0	(67)	(67)	(0,01)
	01/2023	$	128	CHF	121	3	0	3	0,00
	01/2023		7 473	HUF	3 382 008	1 514	0	1 514	0,20
	01/2023		1 150	SEK	11 730	0	(24)	(24)	0,00
	02/2023	ZAR	14 632	$	803	0	(54)	(54)	(0,01)
	03/2023	MXN	710		36	0	0	0	0,00
	03/2023	$	1 884	TWD	57 164	0	(10)	(10)	0,00
	03/2023		2 208	ZAR	38 887	64	0	64	0,01
BOM	01/2023		2 634	CAD	3 537	0	(24)	(24)	0,00
BPS	01/2023	BRL	5 923	$	1 138	16	0	16	0,00
	01/2023	£	1 301		1 572	7	0	7	0,00
	01/2023	HUF	327 819		856	0	(18)	(18)	0,00
	01/2023	ILS	1 367		399	11	0	11	0,00
	01/2023	$	0	THB	2	0	0	0	0,00
	01/2023		1 278	ZAR	22 153	23	0	23	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	02/2023	$	15 039	COP	72 874 971	$ 0	$ (147)	$ (147)	(0,02)
	03/2023	COP	82 861 712	$	17 027	162	0	162	0,02
	03/2023	INR	145 390		1 753	5	0	5	0,00
	03/2023	PEN	13 860		3 565	0	(46)	(46)	(0,01)
	03/2023	TWD	2 112		70	1	0	1	0,00
	03/2023	$	3 998	COP	19 776 915	26	0	26	0,00
	03/2023		2 781	MXN	56 041	56	0	56	0,01
	05/2023	ILS	593	$	184	15	0	15	0,00
	07/2023		11 722		3 679	318	0	318	0,04
BRC	01/2023	CNH	107 981		15 486	0	(139)	(139)	(0,02)
	01/2023	HUF	1 205 375		3 089	0	(121)	(121)	(0,02)
	01/2023	MYR	2 096		477	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$	630	MYR	2 962	47	0	47	0,01
	01/2023		7 569	NOK	75 315	78	0	78	0,01
	01/2023		159	SEK	1 669	1	0	1	0,00
	01/2023		1 169	SGD	1 574	5	0	5	0,00
BSH	03/2023	CLP	1 764 865	$	2 051	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01/2023		2 069 008		2 171	0	(255)	(255)	(0,03)
	01/2023	€	4 010		4 263	0	(19)	(19)	0,00
	01/2023	HUF	1 211 074		3 035	0	(183)	(183)	(0,03)
	01/2023	ILS	17 896		5 668	596	0	596	0,08
	01/2023	PLN	414		84	0	(11)	(11)	0,00
	01/2023	$	879	AUD	1 287	0	(6)	(6)	0,00
	01/2023		8 613	BRL	45 239	0	(45)	(45)	(0,01)
	01/2023		2 219	CAD	3 002	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023		1 161	CHF	1 096	25	0	25	0,00
	01/2023		2 327	CLP	2 069 706	101	0	101	0,01
	01/2023		6 025	€	5 693	54	0	54	0,01
	01/2023		1 297	¥	178 800	59	0	59	0,01
	01/2023		805	NOK	7 983	5	0	5	0,00
	01/2023		6 920	PEN	27 791	352	0	352	0,05
	01/2023		2 663	ZAR	46 666	74	0	74	0,01
	01/2023	ZAR	22 153	$	1 275	0	(25)	(25)	0,00
	02/2023	BRL	6 112		1 133	0	(19)	(19)	0,00
	02/2023	CLP	2 081 106		2 327	0	(103)	(103)	(0,01)
	02/2023	ZAR	41 164		2 364	0	(47)	(47)	(0,01)
	03/2023	COP	10 946 918		2 198	3	(32)	(29)	0,00
	03/2023	PEN	13 836		3 442	0	(166)	(166)	(0,02)
	03/2023	$	4 197	MXN	82 600	11	(28)	(17)	0,00
	03/2023		196	TWD	5 950	0	(1)	(1)	0,00
	04/2023		1 137	PEN	4 550	45	0	45	0,01
	05/2023	ILS	1 876	$	586	50	0	50	0,01
	05/2023	MXN	120		6	0	0	0	0,00
	07/2023	ILS	6 893		2 151	175	0	175	0,02
	08/2023		10 315		3 192	229	0	229	0,03
CLY	01/2023	HUF	511 816		1 311	0	(53)	(53)	(0,01)
DUB	03/2023	$	2 227	MXN	44 250	13	0	13	0,00
GLM	01/2023	BRL	48 610	$	9 095	8	(120)	(112)	(0,02)
	01/2023	CNH	112 081		16 112	0	(106)	(106)	(0,01)
	01/2023	COP	7 890 759		1 631	6	0	6	0,00
	01/2023	HUF	323 754		831	0	(31)	(31)	0,00
	01/2023	THB	7 538		217	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	1 270	BRL	6 633	0	(14)	(14)	0,00
	01/2023		10 360	COP	50 223 796	0	(14)	(14)	0,00
	01/2023		318	HKD	2 477	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		29	THB	1 004	0	0	0	0,00
	01/2023	ZAR	231	$	13	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	COP	21 618 196		4 746	329	0	329	0,04
	03/2023		96 179 839		19 743	172	0	172	0,02
	03/2023	MXN	310 334		15 096	0	(610)	(610)	(0,08)
	03/2023	$	3 985	CLP	3 630 322	237	0	237	0,03
	03/2023		9 530	COP	45 956 043	0	(176)	(176)	(0,02)
	03/2023		6 006	MXN	120 528	94	0	94	0,01
	04/2023	MXN	25 962	$	1 291	0	(16)	(16)	0,00
	04/2023	$	5 314	BRL	28 827	52	0	52	0,01
JPM	01/2023	HUF	1 464 478	$	3 671	0	(220)	(220)	(0,03)
	01/2023	$	412	BRL	2 135	0	(7)	(7)	0,00
	01/2023		42	CNY	290	0	0	0	0,00
	01/2023		1 075	MXN	21 421	22	0	22	0,00
	01/2023	ZAR	23 887	$	1 312	0	(90)	(90)	(0,01)
	02/2023	BRL	2 135		409	7	0	7	0,00
	02/2023	TWD	46 623		1 536	13	0	13	0,00
	02/2023	$	1 084	ZAR	18 899	23	0	23	0,00
	03/2023	IDR	1 154 070	$	74	0	(1)	(1)	0,00
	03/2023	$	75	CNY	517	0	0	0	0,00
	03/2023		4 328	MXN	85 285	12	(23)	(11)	0,00
MBC	01/2023	AUD	1 043	$	697	0	(10)	(10)	0,00
	01/2023	CAD	1 018		746	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	CNH	5 313		766	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	€	6 136		6 474	0	(77)	(77)	(0,01)
	01/2023	£	3 482		4 244	55	0	55	0,01
	01/2023	¥	285 700		2 097	0	(69)	(69)	(0,01)
	01/2023	NZD	2 940		1 883	24	0	24	0,00

Tableau des Investissements Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	01/2023	$	436	AUD	650	$ 5	$ 0	$ 5	0,00
	01/2023		3 382	CAD	4 537	0	(34)	(34)	(0,01)
	01/2023		9 769	CNH	68 082	83	0	83	0,01
	01/2023		2 438	DKK	17 435	65	0	65	0,01
	01/2023		53 209	€	50 755	983	0	983	0,13
	01/2023		824	£	673	0	(14)	(14)	0,00
	01/2023		1 321	HKD	10 282	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023		6 337	¥	862 798	207	0	207	0,03
	01/2023		1 105	SEK	11 300	0	(20)	(20)	0,00
	01/2023		2 064	THB	71 212	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	ZAR	13 949	$	777	0	(41)	(41)	(0,01)
	02/2023	¥	8 120 000		58 702	0	(3 277)	(3 277)	(0,44)
	02/2023	$	133	ZAR	2 410	8	0	8	0,00
	03/2023	IDR	700 457	$	45	0	(1)	(1)	0,00
	03/2023	$	2 134	COP	9 947 932	3	(112)	(109)	(0,02)
	05/2023		727	CNH	4 877	0	(15)	(15)	0,00
MYI	01/2023	CZK	6 683	$	272	0	(23)	(23)	0,00
	01/2023	€	149		159	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	£	1 485		1 810	23	0	23	0,00
	01/2023	HUF	467 144		1 056	0	(185)	(185)	(0,03)
	01/2023	$	13 844	AUD	20 615	140	0	140	0,02
	01/2023		77	€	72	0	0	0	0,00
	01/2023		40	£	33	0	0	0	0,00
	01/2023		16 400	¥	2 248 403	652	0	652	0,09
	01/2023		257	ZAR	4 415	2	0	2	0,00
	01/2023	ZAR	8 830	$	485	0	(33)	(33)	(0,01)
	02/2023	TWD	86 197		2 827	11	0	11	0,00
	02/2023	$	2 322	ZAR	42 306	156	0	156	0,02
	02/2023	ZAR	10 920	$	618	0	(22)	(22)	0,00
	03/2023	COP	955 736		195	1	0	1	0,00
	03/2023	IDR	986 931		63	0	(1)	(1)	0,00
	03/2023	ZAR	38 887		2 195	0	(78)	(78)	(0,01)
RBC	01/2023	$	159	AUD	237	2	0	2	0,00
	01/2023		1 653	CAD	2 250	8	0	8	0,00
	02/2023	MXN	38 635	$	1 949	0	(22)	(22)	0,00
	03/2023	COP	2 147 303		466	29	0	29	0,00
	03/2023	MXN	44 331		2 198	0	(52)	(52)	(0,01)
	03/2023	$	2 937	MXN	58 736	39	0	39	0,01
	09/2023	ZAR	30 034	$	1 668	0	(60)	(60)	(0,01)
RYL	01/2023	¥	72 000		526	0	(21)	(21)	0,00
	01/2023	$	126	HUF	47 624	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	KRW	788 745	$	597	0	(30)	(30)	0,00
	01/2023	$	931	AUD	1 382	6	0	6	0,00
	01/2023		2 297	CAD	3 085	0	(19)	(19)	0,00
	01/2023		234	KRW	300 709	5	0	5	0,00
	01/2023		285	NZD	458	4	0	4	0,00
	02/2023	TWD	43 840	$	1 425	0	(9)	(9)	0,00
	03/2023	CLP	5 165 159		5 914	0	(92)	(92)	(0,01)
	03/2023	$	1 130	COP	5 490 000	0	(12)	(12)	0,00
SOG	01/2023		355	BRL	1 876	0	0	0	0,00
SSB	01/2023	COP	42 333 037	$	8 257	0	(463)	(463)	(0,06)
TOR	01/2023	CZK	4 464		189	0	(8)	(8)	0,00
	01/2023	¥	1 090 000		7 503	0	(778)	(778)	(0,10)
	02/2023	ZAR	81 594		4 726	0	(53)	(53)	(0,01)
UAG	01/2023	BRL	1 350		255	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	CZK	4 082		161	0	(20)	(20)	0,00
	01/2023	£	1 496		1 839	40	0	40	0,01
	01/2023	HUF	318 343		830	0	(18)	(18)	0,00
	01/2023	$	530	CZK	12 733	32	0	32	0,00
	02/2023		4 547	ZAR	84 696	413	0	413	0,05
	03/2023	¥	2 829 154	$	20 684	0	(930)	(930)	(0,12)
	03/2023	MXN	625		31	0	0	0	0,00
	05/2023	CNH	4 878		704	0	(8)	(8)	0,00
	09/2023	$	259	ZAR	4 596	6	0	6	0,00
						$ 8 122	$ (14 677)	$ (6 555)	(0,87)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	CHF	732	$	774	$ 0	$ (18)	$ (18)	0,00
	01/2023	€	7		7	0	0	0	0,00
	01/2023	MXN	15 257		779	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	SGD	1 084		789	0	(19)	(19)	0,00
BOM	01/2023	CAD	3 956		2 946	26	0	26	0,00
BPS	01/2023	SGD	79		58	0	(1)	(1)	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BRC	01/2023	NOK	4 124	$	414	$ 0	$ (4)	$ (4)	0,00
	01/2023	SEK	25 311		2 417	0	(13)	(13)	0,00
CBK	01/2023	AUD	821		554	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	CHF	6 085		6 442	0	(140)	(140)	(0,02)
	01/2023	CNY	118		17	0	0	0	0,00
	01/2023	€	154		163	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	IDR	14 191 102		901	0	(18)	(18)	0,00
	01/2023	INR	406 470		4 963	54	0	54	0,01
	01/2023	PHP	30 800		544	0	(11)	(11)	0,00
	01/2023	SEK	578		56	0	0	0	0,00
	01/2023	TWD	135 987		4 427	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	135 122	€	130 111	3 800	0	3 800	0,50
	01/2023		784	MXN	15 257	0	(2)	(2)	0,00
	02/2023	MXN	15 257	$	781	2	0	2	0,00
GLM	01/2023	BRL	11 861		2 157	0	(89)	(89)	(0,01)
	01/2023	CZK	3 146		134	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	MYR	3 191		679	0	(45)	(45)	(0,01)
	01/2023	PLN	1 305		287	0	(10)	(10)	0,00
	01/2023	$	2 240	BRL	11 861	7	0	7	0,00
	01/2023		722	MYR	3 191	2	0	2	0,00
	02/2023	BRL	11 861	$	2 226	0	(8)	(8)	0,00
	02/2023	MYR	3 191		723	0	(7)	(7)	0,00
JPM	01/2023	£	9 340		11 278	41	0	41	0,01
	01/2023	ZAR	38		2	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	AUD	236		158	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	CAD	5 567		4 150	42	0	42	0,01
	01/2023	CZK	15		1	0	0	0	0,00
	01/2023	DKK	14 812		2 071	0	(55)	(55)	(0,01)
	01/2023	€	1 825		1 942	0	(7)	(7)	0,00
	01/2023	ILS	800		234	7	0	7	0,00
	01/2023	INR	109		1	0	0	0	0,00
	01/2023	¥	487 169		3 551	0	(144)	(144)	(0,02)
	01/2023	NOK	440		45	0	0	0	0,00
	01/2023	$	185 305	€	176 820	3 487	0	3 487	0,46
MYI	01/2023	AUD	7 473	$	5 018	0	(50)	(50)	(0,01)
	01/2023	¥	1 789 507		13 053	0	(520)	(520)	(0,07)
	01/2023	ZAR	27 243		1 601	0	0	0	0,00
RBC	01/2023	AUD	86		58	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01/2023		501		338	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	CAD	3 451		2 569	22	0	22	0,00
	01/2023	CNY	12 672		1 775	0	(59)	(59)	(0,01)
	01/2023	NZD	402		251	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	$	166 514	€	159 979	4 297	0	4 297	0,57
SOG	01/2023	HKD	14 937	$	1 918	4	0	4	0,00
	01/2023	KRW	4 754 773		3 579	0	(201)	(201)	(0,03)
UAG	01/2023	CLP	144 422		152	0	(17)	(17)	0,00
	01/2023	HKD	57 167		7 315	0	(11)	(11)	0,00
	01/2023	HUF	57 263		145	0	(8)	(8)	0,00
	01/2023	IDR	10 961		1	0	0	0	0,00
	01/2023	SEK	1 615		154	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	THB	30 499		866	0	(15)	(15)	0,00
	01/2023	$	165	CLP	144 422	4	0	4	0,00
	01/2023		9	KRW	11 477	0	0	0	0,00
	02/2023	CLP	144 422	$	165	0	(4)	(4)	0,00
						$ 11 795	$ (1 500)	$ 10 295	1,37

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	CHF	6	$	7	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	£	161		194	0	0	0	0,00
	01/2023	MXN	171		9	0	0	0	0,00
	01/2023	SGD	11		8	0	0	0	0,00
BOM	01/2023	CAD	33		24	0	0	0	0,00
BPS	01/2023	SGD	1		1	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	£	33		40	0	0	0	0,00
	01/2023	NOK	50		5	0	0	0	0,00
	01/2023	SEK	197		19	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	CHF	53		56	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	CNY	1		0	0	0	0	0,00
	01/2023	IDR	86 687		6	0	0	0	0,00
	01/2023	INR	3 259		40	0	0	0	0,00
	01/2023	PHP	147		3	0	0	0	0,00
	01/2023	SEK	5		0	0	0	0	0,00
	01/2023	TWD	1 104		36	0	0	0	0,00
	01/2023	$	4	CAD	5	0	0	0	0,00
	01/2023		9	€	9	0	0	0	0,00
	01/2023		6	¥	871	0	0	0	0,00
	01/2023		9	MXN	171	0	0	0	0,00

Tableau des Investissements Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	02/2023	MXN	171	$	9	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
GLM	01/2023	BRL	88		16	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	CZK	38		2	0	0	0	0,00
	01/2023	MYR	22		5	0	0	0	0,00
	01/2023	PLN	16		3	0	0	0	0,00
	01/2023	$	17	BRL	88	0	0	0	0,00
	01/2023		5	MYR	22	0	0	0	0,00
	02/2023	BRL	88	$	17	0	0	0	0,00
	02/2023	MYR	22		5	0	0	0	0,00
JPM	01/2023	$	1 443	£	1 195	0	(5)	(5)	0,00
MBC	01/2023	AUD	2	$	1	0	0	0	0,00
	01/2023	CAD	50		37	0	0	0	0,00
	01/2023	CZK	0		0	0	0	0	0,00
	01/2023	DKK	136		19	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	€	204		214	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	ILS	12		4	0	0	0	0,00
	01/2023	INR	1		0	0	0	0	0,00
	01/2023	¥	4 306		31	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	NOK	5		1	0	0	0	0,00
	01/2023	$	2	€	2	0	0	0	0,00
	01/2023		1 329	£	1 107	5	(2)	3	0,00
MYI	01/2023	AUD	61	$	41	0	0	0	0,00
	01/2023	¥	15 166		111	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	$	3	CHF	3	0	0	0	0,00
	01/2023		56	£	46	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	ZAR	187	$	11	0	0	0	0,00
RBC	01/2023	AUD	1		0	0	0	0	0,00
	01/2023	$	3	HKD	23	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	AUD	4	$	3	0	0	0	0,00
	01/2023	CAD	29		21	0	0	0	0,00
	01/2023	CNY	102		14	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	NZD	5		3	0	0	0	0,00
SOG	01/2023	HKD	121		16	0	0	0	0,00
	01/2023	KRW	38 515		29	0	(2)	(2)	0,00
TOR	01/2023	$	1 428	£	1 188	1	0	1	0,00
UAG	01/2023	CLP	2 256	$	2	0	0	0	0,00
	01/2023	HKD	495		63	0	0	0	0,00
	01/2023	HUF	692		2	0	0	0	0,00
	01/2023	IDR	71		0	0	0	0	0,00
	01/2023	SEK	13		1	0	0	0	0,00
	01/2023	THB	303		9	0	0	0	0,00
	01/2023	$	3	CLP	2 256	0	0	0	0,00
	01/2023		0	KRW	93	0	0	0	0,00
	02/2023	CLP	2 256	$	3	0	0	0	0,00
						$ 6	$ (23)	$ (17)	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ 3 428**	**0,45**
Total des Investissements	**$ 728 692**	**97,15**
Autres actifs et passifs à court terme	**$ 21 384**	**2,85**
Actif net	**$ 750 076**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(d) Titre à coupon zéro.

(e) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(f) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(g) Affilié au Fonds.

Un montant en numéraire de 35 607 $ (31 décembre 2021 : 55 630 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un titre d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 855 $) et un montant en numéraire de 5 030 $ (31 décembre 2021 : 5 340 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 94 207	$ 379 228	$ 0	$ 473 435
Fonds d'investissement	151 214	100 275	0	251 489
Contrats de mise en pension	0	18 536	0	18 536
Instruments financiers dérivés[3]	(15 794)	1 026	0	(14 768)
Totaux	**$ 229 627**	**$ 499 065**	**$ 0**	**$ 728 692**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 124 910	$ 450 226	$ 648	$ 575 784
Fonds d'investissement	388 149	0	0	388 149
Contrats de mise en pension	0	511	0	511
Instruments financiers dérivés[3]	11 497	8 311	0	19 808
Titres vendus à découvert	0	(84 769)	0	(84 769)
Totaux	**$ 524 556**	**$ 374 279**	**$ 648**	**$ 899 483**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ (3 503)	$ 1 500	$ (2 003)	$ (584)	$ 855	$ 271
BOM	2	0	2	S/O	S/O	S/O
BPS	485	(1 380)	(895)	(251)	980	729
BRC	(222)	450	228	40	0	40
BSH	(1)	0	(1)	S/O	S/O	S/O
CBK	4 514	(4 480)	34	364	(310)	54
CLY	(53)	0	(53)	S/O	S/O	S/O
DUB	13	0	13	(29)	0	(29)
GLM	(829)	420	(409)	285	(630)	(345)
GST	15	(20)	(5)	24	(20)	4
HUS	S/O	S/O	S/O	241	(330)	(89)
JPM	(36)	(590)	(626)	(132)	620	488
MBC	1 039	(1 100)	(61)	S/O	S/O	S/O
MEI	7	(440)	(433)	S/O	S/O	S/O
MYC	(27)	180	153	66	(195)	(129)
MYI	(55)	780	725	308	(330)	(22)
NAB	S/O	S/O	S/O	383	(300)	83
RBC	(57)	0	(57)	1 910	(1 520)	390
RYL	(21)	0	(21)	S/O	S/O	S/O
SAL	(18)	0	(18)	14	0	14
SCX	4 106	(3 980)	126	2 559	(1 480)	1 079
SOG	(81)	(280)	(361)	18	3 740	3 758
SSB	(463)	590	127	(8)	0	(8)
TOR	(838)	690	(148)	2 137	(1 280)	857
UAG	(549)	420	(129)	223	(270)	(47)

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	25,87	33,48
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	35,98	21,09
Autres valeurs mobilières	1,28	1,06
Fonds d'investissement	33,53	37,50
Contrats de mise en pension	2,47	0,05
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(2,13)	1,11
Instruments financiers dérivés compensés	(0,30)	0,07
Instruments financiers dérivés hors cote	0,45	0,73
Titres vendus à découvert	S/O	(8,19)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Crédits consortiaux et cessions	S/O	0,39
Obligations et billets privés	3,39	8,14
Obligations et billets convertibles	0,12	0,11
Agences du gouvernement américain	4,77	1,05
Obligations du Trésor américain	1,20	0,50
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	1,66	1,11
Titres adossés à des actifs	7,95	4,81
Émissions souveraines	7,97	12,31
Actions ordinaires	6,88	8,25
Titres privilégiés	0,16	0,20
Sociétés d'investissement immobilier	5,86	5,92
Instruments à court terme	23,17	12,84
Fonds d'investissement	33,53	37,50
Contrats de mise en pension	2,47	0,05
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(2,13)	1,11
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,01)	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,07	0,01
Swaps de taux d'intérêt	(0,36)	0,06
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Options de change	S/O	0,00
Options vendues		
Options de change	S/O	0,00
Options plafonnées sur l'inflation	(0,06)	(0,01)
Swaptions de taux d'intérêt	(0,01)	S/O
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	(0,01)	0,02
Swaps de taux d'intérêt	(0,04)	(0,02)
Swaps de rendement total sur indices	0,05	0,01
Swaps de rendement total sur titres	0,02	(0,03)
Contrats de change à terme	(0,87)	0,24
Contrats de change à terme couverts	1,37	0,52
Titres vendus à découvert	S/O	(8,19)
Autres actifs et passifs à court terme	2,85	13,10
Actif net	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES					
BELGIQUE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Ontex Group NV					
3,500 % éch. 15/07/2026	€	7 500	$	6 800	0,22
BERMUDES					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
NCL Corp. Ltd.					
5,875 % éch. 15/03/2026	$	2 850		2 244	0,07
5,875 % éch. 15/02/2027		1 875		1 626	0,05
Viking Cruises Ltd.					
5,875 % éch. 15/09/2027		4 000		3 267	0,11
13,000 % éch. 15/05/2025		2 000		2 113	0,07
VOC Escrow Ltd.					
5,000 % éch. 15/02/2028		3 500		3 016	0,10
Total Bermudes				12 266	0,40
CANADA					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Air Canada					
3,875 % éch. 15/08/2026		3 250		2 884	0,10
4,625 % éch. 15/08/2029	CAD	3 000		1 941	0,06
B.C. Unlimited Liability Co.					
3,500 % éch. 15/02/2029	$	4 000		3 436	0,11
4,000 % éch. 15/10/2030		10 000		8 119	0,26
4,375 % éch. 15/01/2028		2 500		2 242	0,07
Bausch Health Cos., Inc.					
4,875 % éch. 01/06/2028		3 500		2 233	0,07
5,500 % éch. 01/11/2025		3 000		2 555	0,08
5,750 % éch. 15/08/2027		2 500		1 705	0,06
Bombardier, Inc.					
7,125 % éch. 15/06/2026		6 000		5 832	0,19
7,500 % éch. 15/03/2025		2 901		2 879	0,09
7,875 % éch. 15/04/2027		3 000		2 916	0,10
GFL Environmental, Inc.					
3,500 % éch. 01/09/2028		5 000		4 402	0,14
4,000 % éch. 01/08/2028		3 000		2 569	0,08
Strathcona Resources Ltd.					
6,875 % éch. 01/08/2026		5 875		4 295	0,14
Total Canada				48 008	1,55
ÎLES CAÏMANS					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Diamond Foreign Asset Co. (9,000 % en numéraire ou 9,000 % de rémunération en nature)					
9,000 % éch. 22/04/2027 (a)(g)		66		62	0,00
9,000 % éch. 22/04/2027 (a)		18		17	0,00
Noble Finance Co. (11,000 % en numéraire ou 15,000 % de rémunération en nature)					
11,000 % éch. 15/02/2028 (a)		976		1 085	0,04
Spirit Loyalty Cayman Ltd.					
8,000 % éch. 20/09/2025		5 000		5 032	0,16
UPCB Finance Ltd.					
3,625 % éch. 15/06/2029	€	12 500		11 895	0,38
Wynn Macau Ltd.					
5,125 % éch. 15/12/2029	$	2 500		2 027	0,07
5,500 % éch. 01/10/2027		4 500		3 941	0,13
Total Îles Caïmans				24 059	0,78
DANEMARK					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Norican A/S					
4,500 % éch. 15/05/2023	€	2 700		2 726	0,09
FRANCE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Accor S.A.					
2,375 % éch. 29/11/2028		5 000		4 577	0,15
Altice France S.A.					
3,375 % éch. 15/01/2028		7 000		5 655	0,18
4,000 % éch. 15/07/2029		3 000		2 431	0,08
4,125 % éch. 15/01/2029		3 000		2 454	0,08
5,500 % éch. 15/01/2028	$	10 000		7 853	0,25
5,500 % éch. 15/10/2029		5 000		3 822	0,12
Banijay Entertainment SASU					
5,375 % éch. 01/03/2025	$	2 750		2 603	0,08
CAB SELAS					
3,375 % éch. 01/02/2028	€	10 000		8 610	0,28
Chrome Bidco SASU					
3,500 % éch. 31/05/2028		3 400		3 061	0,10
Chrome Holdco SASU					
5,000 % éch. 31/05/2029		3 850		3 207	0,10
Elior Group S.A.					
3,750 % éch. 15/07/2026		4 400		3 984	0,13
Rexel S.A.					
2,125 % éch. 15/12/2028		7 000		6 509	0,21
Verallia S.A.					
1,875 % éch. 10/11/2031		7 000		5 847	0,19
Total France				60 613	1,95
ALLEMAGNE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Cheplapharm Arzneimittel GmbH					
3,500 % éch. 11/02/2027		5 000		4 691	0,15
4,375 % éch. 15/01/2028		5 000		4 705	0,15
Ctec GmbH					
5,250 % éch. 15/02/2030		12 000		10 707	0,35
IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % en numéraire ou 4,375 % de rémunération en nature)					
3,625 % éch. 15/05/2025 (a)		2 750		2 685	0,09
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % en numéraire ou 4,500 % de rémunération en nature)					
3,750 % éch. 15/09/2026 (a)		3 000		2 793	0,09
IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % en numéraire ou 4,625 % de rémunération en nature)					
3,875 % éch. 15/05/2027 (a)		2 000		1 811	0,06
IHO Verwaltungs GmbH (4,750 % en numéraire ou 5,500 % de rémunération en nature)					
4,750 % éch. 15/09/2026 (a)	$	5 000		4 335	0,14
Nidda Healthcare Holding GmbH					
3,500 % éch. 30/09/2024	€	677		706	0,02
7,500 % éch. 21/08/2026		17 000		17 383	0,56
Techem Verwaltungsgesellschaft mbH					
2,000 % éch. 15/07/2025		10 000		9 843	0,32
TK Elevator Midco GmbH					
4,375 % éch. 15/07/2027		7 000		6 667	0,21
WEPA Hygieneprodukte GmbH					
2,875 % éch. 15/12/2027		10 000		8 752	0,28
ZF Finance GmbH					
2,250 % éch. 03/05/2028		5 000		4 187	0,13
3,750 % éch. 21/09/2028		4 000		3 600	0,12
Total Allemagne				82 865	2,67
IRLANDE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Motion Bondco DAC					
4,500 % éch. 15/11/2027		3 000		2 639	0,08
6,625 % éch. 15/11/2027	$	5 000		4 312	0,14
Total Irlande				6 951	0,22
ITALIE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Atlantia SpA					
1,625 % éch. 03/02/2025	€	2 000		1 999	0,06
1,875 % éch. 13/07/2027		10 000		9 096	0,29
1,875 % éch. 12/02/2028		12 500		11 123	0,36
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA					
5,375 % éch. 18/01/2028		3 000		2 589	0,08
8,000 % éch. 22/01/2030		3 000		2 809	0,09
10,500 % éch. 23/07/2029		3 000		2 974	0,10
FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA					
5,625 % éch. 01/08/2027		5 800		4 956	0,16
IMA Industria Macchine Automatiche SpA					
3,750 % éch. 15/01/2028		12 000		10 605	0,34
Inter Media and Communication SpA					
6,750 % éch. 09/02/2027		6 000		6 087	0,20
Intesa Sanpaolo SpA					
4,198 % éch. 01/06/2032	$	1 000		737	0,02
4,950 % éch. 01/06/2042		2 000		1 290	0,04
5,710 % éch. 15/01/2026		5 000		4 810	0,16
5,875 % éch. 01/09/2031 (d)(f)	€	5 000		4 310	0,14
7,700 % éch. 17/09/2025 (d)(f)	$	7 000		6 369	0,21
7,750 % éch. 11/01/2027 (d)(f)	€	4 000		4 129	0,13
Nexi SpA					
1,625 % éch. 30/04/2026	€	8 000	$	7 803	0,25
2,125 % éch. 30/04/2029		11 000		9 557	0,31
Shiba BidCo SpA					
4,500 % éch. 31/10/2028		5 000		4 609	0,15
Telecom Italia SpA					
1,625 % éch. 18/01/2029		5 000		4 094	0,13
5,303 % éch. 30/05/2024	$	2 000		1 899	0,06
UniCredit SpA					
3,875 % éch. 03/06/2027 (d)(f)	€	4 000		3 188	0,10
5,459 % éch. 30/06/2035	$	14 000		11 402	0,37
Total Italie				116 435	3,75
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Adient Global Holdings Ltd.					
3,500 % éch. 15/08/2024	€	5 000		5 135	0,17
4,875 % éch. 15/08/2026	$	1 000		932	0,03
Total Jersey, Îles Anglo-normandes				6 067	0,20
LIBERIA					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Royal Caribbean Cruises Ltd.					
4,250 % éch. 01/07/2026		5 000		4 048	0,13
5,500 % éch. 31/08/2026		10 000		8 425	0,27
5,500 % éch. 01/04/2028		5 000		3 999	0,13
11,500 % éch. 01/06/2025		3 991		4 289	0,14
Total Liberia				20 761	0,67
LUXEMBOURG					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Albion Financing SARL					
6,125 % éch. 15/10/2026		6 125		5 471	0,18
Altice Financing S.A.					
3,000 % éch. 15/01/2028	€	6 000		5 076	0,16
5,750 % éch. 15/08/2029	$	5 000		3 942	0,13
Altice France Holding S.A.					
4,000 % éch. 15/02/2028	€	4 000		2 766	0,09
Aramark International Finance SARL					
3,125 % éch. 01/04/2025		5 000		5 136	0,17
BK LC Lux Finco SARL					
5,250 % éch. 30/04/2029		3 000		2 783	0,09
Camelot Finance S.A.					
4,500 % éch. 01/11/2026	$	4 750		4 459	0,14
Cirsa Finance International SARL					
4,500 % éch. 15/03/2027	€	5 000		4 625	0,15
4,750 % éch. 22/05/2025		4 000		4 051	0,13
6,250 % éch. 20/12/2023		1 207		1 282	0,04
Herens Holdco SARL					
4,750 % éch. 15/05/2028	$	3 000		2 246	0,07
Herens Midco SARL					
5,250 % éch. 15/05/2029	€	12 500		9 310	0,30
InPost S.A.					
2,250 % éch. 15/07/2027		2 925		2 591	0,08
LHMC Finco 2 SARL (7,250 % en numéraire ou 8,000 % de rémunération en nature)					
7,250 % éch. 02/10/2025 (a)		3 650		3 380	0,11
Lincoln Financing SARL					
3,625 % éch. 01/04/2024		5 000		5 284	0,17
Summer BC Holdco SARL					
5,750 % éch. 31/10/2026		4 000		3 655	0,12
9,250 % éch. 31/10/2027		3 154		2 568	0,08
Telecom Italia Capital S.A.					
6,375 % éch. 15/11/2033	$	7 000		5 738	0,18
7,200 % éch. 18/07/2036		3 000		2 441	0,08
Total Luxembourg				76 804	2,47
MULTINATIONALES					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Allied Universal Holdco LLC					
3,625 % éch. 01/06/2028	€	6 000		5 104	0,16
4,875 % éch. 01/06/2028	£	4 250		4 053	0,13
American Airlines, Inc.					
5,500 % éch. 20/04/2026	$	10 000		9 634	0,31
5,750 % éch. 20/04/2029		8 000		7 326	0,24

Tableau des investissements Fonds Global High Yield Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC				
3,000 % éch. 01/09/2029	€	3 075	$ 2 412	0,08
3,250 % éch. 01/09/2028	$	3 000	2 552	0,08
4,000 % éch. 01/09/2029		1 000	795	0,03
Clarios Global LP				
4,375 % éch. 15/05/2026	€	10 000	9 896	0,32
Connect Finco SARL				
6,750 % éch. 01/10/2026	$	5 000	4 644	0,15
Endo DAC				
6,000 % éch. 30/06/2028 ^		4 000	220	0,01
Paysafe Finance PLC				
3,000 % éch. 15/06/2029	€	1 875	1 557	0,05
4,000 % éch. 15/06/2029 (h)	$	4 500	3 482	0,11
Total Multinationales			51 675	1,67
PAYS-BAS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Ashland Services BV				
2,000 % éch. 30/01/2028	€	15 000	13 714	0,44
Axalta Coating Systems Dutch Holding BV				
3,750 % éch. 15/01/2025		10 000	10 253	0,33
Clear Channel International BV				
6,625 % éch. 01/08/2025	$	3 000	2 867	0,09
Diamond BC BV				
4,625 % éch. 01/10/2029		15 000	12 057	0,39
Dufry One BV				
2,000 % éch. 15/02/2027 (h)	€	14 250	12 490	0,40
3,375 % éch. 15/04/2028		10 000	8 881	0,28
Energizer Gamma Acquisition BV				
3,500 % éch. 30/06/2029		10 000	8 576	0,28
LeasePlan Corp. NV				
7,375 % éch. 29/05/2024 (d)(f)		7 000	7 422	0,24
Q-Park Holding BV				
1,500 % éch. 01/03/2025		4 000	3 929	0,13
2,000 % éch. 01/03/2027		7 000	6 265	0,20
Schoeller Packaging BV				
6,375 % éch. 01/11/2024		4 000	2 963	0,09
Sensata Technologies BV				
5,000 % éch. 01/10/2025	$	1 000	978	0,03
Sigma Holdco BV				
5,750 % éch. 15/05/2026	€	4 000	3 095	0,10
7,875 % éch. 15/05/2026	$	2 500	1 792	0,06
TMNL Holding BV				
3,750 % éch. 15/01/2029	€	10 000	9 378	0,30
Trivium Packaging Finance BV				
3,750 % éch. 15/08/2026		5 000	4 896	0,16
United Group BV				
3,125 % éch. 15/02/2026		10 000	8 610	0,28
3,625 % éch. 15/02/2028		1 500	1 164	0,04
4,000 % éch. 15/11/2027		1 500	1 198	0,04
UPC Holding BV				
3,875 % éch. 15/06/2029		10 000	8 917	0,29
ZF Europe Finance BV				
2,000 % éch. 23/02/2026		3 000	2 770	0,09
3,000 % éch. 23/10/2029		5 600	4 587	0,15
Ziggo Bond Co. BV				
3,375 % éch. 28/02/2030		10 000	7 752	0,25
5,125 % éch. 28/02/2030	$	5 000	4 046	0,13
6,000 % éch. 15/01/2027		2 500	2 330	0,07
Ziggo BV				
2,875 % éch. 15/01/2030	€	5 000	4 299	0,14
Total Pays-Bas			155 229	5,00
NORVÈGE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Adevinta ASA				
2,625 % éch. 15/11/2025		8 000	7 962	0,26
3,000 % éch. 15/11/2027		2 750	2 606	0,08
Total Norvège			10 568	0,34
PANAMA				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Carnival Corp.				
4,000 % éch. 01/08/2028	$	7 000	5 722	0,18
5,750 % éch. 01/03/2027		10 000	7 158	0,23
6,000 % éch. 01/05/2029	$	2 000	$ 1 336	0,04
7,625 % éch. 01/03/2026		3 000	2 383	0,08
Total Panama			16 599	0,53
ESPAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Cellnex Finance Co. S.A.				
2,000 % éch. 15/09/2032	€	10 000	7 955	0,26
2,000 % éch. 15/02/2033		3 000	2 363	0,08
3,875 % éch. 07/07/2041	$	2 400	1 645	0,05
Cellnex Telecom S.A.				
1,000 % éch. 20/04/2027	€	4 100	3 734	0,12
1,875 % éch. 26/06/2029		5 000	4 362	0,14
Grifols Escrow Issuer S.A.				
3,875 % éch. 15/10/2028		7 000	6 319	0,20
Grifols S.A.				
1,625 % éch. 15/02/2025		2 000	2 023	0,06
2,250 % éch. 15/11/2027		5 000	4 674	0,15
Kaixo Bondco Telecom S.A.				
5,125 % éch. 30/09/2029		7 000	6 387	0,21
Lorca Telecom Bondco S.A.				
4,000 % éch. 18/09/2027		14 000	13 429	0,43
Total Espagne			52 891	1,70
SUÈDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Dometic Group AB				
2,000 % éch. 29/09/2028		5 000	4 240	0,14
Intrum AB				
3,000 % éch. 15/09/2027		10 000	8 563	0,28
3,500 % éch. 15/07/2026		2 000	1 802	0,06
4,875 % éch. 15/08/2025		2 000	1 949	0,06
Verisure Holding AB				
3,250 % éch. 15/02/2027		10 000	9 289	0,30
Verisure Midholding AB				
5,250 % éch. 15/02/2029		2 650	2 270	0,07
Total Suède			28 113	0,91
SUISSE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Credit Suisse Group AG				
6,375 % éch. 21/08/2026 (d)(f)	$	4 900	3 524	0,11
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BCP Modular Services Finance PLC				
4,750 % éch. 30/11/2028	€	10 000	8 984	0,29
6,750 % éch. 30/11/2029		10 000	7 939	0,26
Bellis Acquisition Co. PLC				
3,250 % éch. 16/02/2026	£	10 000	9 832	0,32
Bellis Finco PLC				
4,000 % éch. 16/02/2027		4 000	3 559	0,11
Boparan Finance PLC				
7,625 % éch. 30/11/2025 (h)		5 000	4 113	0,13
Carnival PLC				
1,000 % éch. 28/10/2029	€	10 000	4 457	0,14
Heathrow Finance PLC				
4,125 % éch. 01/09/2029	£	3 333	3 018	0,10
INEOS Finance PLC				
2,875 % éch. 01/05/2026	€	5 000	4 616	0,15
INEOS Quattro Finance PLC				
2,500 % éch. 15/01/2026		4 000	3 641	0,12
3,750 % éch. 15/07/2026		2 475	2 184	0,07
International Game Technology PLC				
2,375 % éch. 15/04/2028		8 000	7 436	0,24
6,500 % éch. 15/02/2025	$	1 585	1 597	0,05
Lloyds Banking Group PLC				
7,500 % éch. 27/06/2024 (d)(f)		6 000	5 829	0,19
Rolls-Royce PLC				
0,875 % éch. 09/05/2024	€	3 000	3 022	0,10
4,625 % éch. 16/02/2026		2 500	2 595	0,08
5,750 % éch. 15/10/2027	£	4 000	4 429	0,14
Virgin Media Finance PLC				
3,750 % éch. 15/07/2030	€	10 000	8 244	0,27
5,000 % éch. 15/07/2030	$	4 000	3 215	0,10
Virgin Media Secured Finance PLC				
4,250 % éch. 15/01/2030	£	10 000	$ 9 385	0,30
Vmed O2 UK Financing PLC				
3,250 % éch. 31/01/2031	€	10 750	9 165	0,30
4,750 % éch. 15/07/2031	$	6 250	5 089	0,16
Vodafone Group PLC				
7,000 % éch. 04/04/2079		4 000	4 027	0,13
Zenith Finco PLC				
6,500 % éch. 30/06/2027	£	3 000	2 830	0,09
Total Royaume-Uni			119 206	3,84
ÉTATS-UNIS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Academy Ltd.				
6,000 % éch. 15/11/2027	$	5 000	4 794	0,15
Acadia Healthcare Co., Inc.				
5,000 % éch. 15/04/2029		5 000	4 607	0,15
AdaptHealth LLC				
5,125 % éch. 01/03/2030		1 000	853	0,03
6,125 % éch. 01/08/2028		2 000	1 841	0,06
ADT Security Corp.				
4,875 % éch. 15/07/2032		4 000	3 406	0,11
Advantage Sales & Marketing, Inc.				
6,500 % éch. 15/11/2028		7 000	5 348	0,17
Albertsons Cos., Inc.				
3,500 % éch. 15/03/2029		5 000	4 206	0,14
4,625 % éch. 15/01/2027		2 000	1 862	0,06
Allison Transmission, Inc.				
3,750 % éch. 30/01/2031		2 000	1 648	0,05
4,750 % éch. 01/10/2027		2 000	1 858	0,06
AMC Networks, Inc.				
4,250 % éch. 15/02/2029		7 000	4 372	0,14
American Airlines Pass-Through Trust				
3,375 % éch. 01/11/2028		313	262	0,01
American Builders & Contractors Supply Co., Inc.				
3,875 % éch. 15/11/2029		4 500	3 684	0,12
4,000 % éch. 15/01/2028		10 000	8 939	0,29
Amsted Industries, Inc.				
4,625 % éch. 15/05/2030		5 000	4 287	0,14
AmWINS Group, Inc.				
4,875 % éch. 30/06/2029		5 000	4 247	0,14
ANGI Group LLC				
3,875 % éch. 15/08/2028		2 000	1 487	0,05
Antero Midstream Partners LP				
5,375 % éch. 15/06/2029		5 000	4 578	0,15
Antero Resources Corp.				
5,375 % éch. 01/03/2030		4 000	3 714	0,12
Apache Corp.				
4,875 % éch. 15/11/2027		5 000	4 564	0,15
APi Group DE, Inc.				
4,750 % éch. 15/10/2029		3 000	2 616	0,08
Aramark Services, Inc.				
5,000 % éch. 01/02/2028		3 000	2 805	0,09
Ascent Resources Utica Holdings LLC				
5,875 % éch. 30/06/2029		3 000	2 679	0,09
ASP Unifrax Holdings, Inc.				
5,250 % éch. 30/09/2028		5 000	4 030	0,13
7,500 % éch. 30/09/2029		2 000	1 272	0,04
At Home Group, Inc.				
4,875 % éch. 15/07/2028		1 000	706	0,02
Avantor Funding, Inc.				
3,875 % éch. 15/07/2028	€	4 750	4 698	0,15
4,625 % éch. 15/07/2028	$	2 500	2 277	0,07
Ball Corp.				
1,500 % éch. 15/03/2027	€	5 000	4 743	0,15
2,875 % éch. 15/08/2030	$	7 500	6 002	0,19
3,125 % éch. 15/09/2031		4 000	3 218	0,10
Bath & Body Works, Inc.				
6,625 % éch. 01/10/2030		4 000	3 760	0,12
6,875 % éch. 01/11/2035		7 000	6 235	0,20
BCPE Empire Holdings, Inc.				
7,625 % éch. 01/05/2027		12 000	10 776	0,35
Black Knight InfoServ LLC				
3,625 % éch. 01/09/2028		5 000	4 350	0,14

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Blue Racer Midstream LLC					
7,625 % éch. 15/12/2025	$	5 000	$	4 969	0,16
Boxer Parent Co., Inc.					
6,500 % éch. 02/10/2025	€	5 000		5 102	0,16
Boyd Gaming Corp.					
4,750 % éch. 01/12/2027	$	2 000		1 866	0,06
4,750 % éch. 15/06/2031		4 000		3 485	0,11
Boyne USA, Inc.					
4,750 % éch. 15/05/2029		5 000		4 432	0,14
Buckeye Partners LP					
4,125 % éch. 01/03/2025		3 000		2 862	0,09
4,500 % éch. 01/03/2028		2 500		2 201	0,07
Builders FirstSource, Inc.					
4,250 % éch. 01/02/2032		3 000		2 437	0,08
5,000 % éch. 01/03/2030		5 000		4 439	0,14
Caesars Entertainment, Inc.					
4,625 % éch. 15/10/2029		5 925		4 832	0,16
6,250 % éch. 01/07/2025		5 000		4 869	0,16
Callon Petroleum Co.					
7,500 % éch. 15/06/2030		3 000		2 749	0,09
Calpine Corp.					
3,750 % éch. 01/03/2031		2 000		1 613	0,05
4,500 % éch. 15/02/2028		4 000		3 577	0,12
4,625 % éch. 01/02/2029		1 500		1 289	0,04
5,125 % éch. 15/03/2028		4 000		3 577	0,12
5,250 % éch. 01/06/2026		663		633	0,02
Catalent Pharma Solutions, Inc.					
2,375 % éch. 01/03/2028	€	20 000		17 487	0,56
5,000 % éch. 15/07/2027	$	1 000		932	0,03
CCO Holdings LLC					
4,250 % éch. 01/02/2031		5 000		4 022	0,13
4,250 % éch. 15/01/2034		7 000		5 180	0,17
4,500 % éch. 15/08/2030		10 000		8 284	0,27
4,500 % éch. 01/05/2032		10 000		7 979	0,26
4,500 % éch. 01/06/2033		5 000		3 846	0,12
4,750 % éch. 01/03/2030		7 000		6 053	0,19
5,125 % éch. 01/05/2027		9 000		8 408	0,27
5,375 % éch. 01/06/2029		3 500		3 173	0,10
CDI Escrow Issuer, Inc.					
5,750 % éch. 01/04/2030		3 750		3 368	0,11
Central Garden & Pet Co.					
4,125 % éch. 30/04/2031		4 000		3 316	0,11
Charles River Laboratories International, Inc.					
3,750 % éch. 15/03/2029		2 000		1 772	0,06
4,000 % éch. 15/03/2031		1 000		866	0,03
Cheniere Energy Partners LP					
4,500 % éch. 01/10/2029		4 000		3 606	0,12
Cheniere Energy, Inc.					
4,625 % éch. 15/10/2028		5 000		4 529	0,15
Chesapeake Energy Corp.					
5,500 % éch. 01/02/2026		2 000		1 933	0,06
5,875 % éch. 01/02/2029		1 500		1 423	0,05
6,750 % éch. 15/04/2029		12 000		11 699	0,38
Clarivate Science Holdings Corp.					
3,875 % éch. 01/07/2028		3 875		3 362	0,11
4,875 % éch. 01/07/2029		4 000		3 407	0,11
Clearway Energy Operating LLC					
3,750 % éch. 15/01/2032		5 000		4 027	0,13
4,750 % éch. 15/03/2028		2 000		1 849	0,06
Cloud Software Group Holdings, Inc.					
6,500 % éch. 31/03/2029		7 000		5 908	0,19
Coinbase Global, Inc.					
3,375 % éch. 01/10/2028		1 500		795	0,03
3,625 % éch. 01/10/2031		2 000		966	0,03
Colgate Energy Partners LLC					
5,875 % éch. 01/07/2029		3 000		2 580	0,08
CommScope Technologies LLC					
5,000 % éch. 15/03/2027		5 000		3 404	0,11
6,000 % éch. 15/06/2025		1 334		1 217	0,04
CommScope, Inc.					
4,750 % éch. 01/09/2029		10 000		8 081	0,26
6,000 % éch. 01/03/2026		2 000		1 850	0,06
7,125 % éch. 01/07/2028		3 000		2 149	0,07
8,250 % éch. 01/03/2027		3 000		2 330	0,08
Community Health Systems, Inc.					
4,750 % éch. 15/02/2031		5 000		3 639	0,12
5,250 % éch. 15/05/2030		5 000		3 779	0,12
5,625 % éch. 15/03/2027	$	8 000	$	6 874	0,22
6,000 % éch. 15/01/2029		1 625		1 361	0,04
6,875 % éch. 15/04/2029		3 000		1 547	0,05
Comstock Resources, Inc.					
5,875 % éch. 15/01/2030		2 000		1 722	0,06
6,750 % éch. 01/03/2029		4 000		3 617	0,12
CoreLogic, Inc.					
4,500 % éch. 01/05/2028		7 000		5 379	0,17
Cornerstone Building Brands, Inc.					
6,125 % éch. 15/01/2029		1 500		1 059	0,03
Coty, Inc.					
3,875 % éch. 15/04/2026	€	7 750		7 726	0,25
5,000 % éch. 15/04/2026	$	1 000		950	0,03
Covanta Holding Corp.					
4,875 % éch. 01/12/2029		3 000		2 462	0,08
5,000 % éch. 01/09/2030		3 000		2 429	0,08
Crocs, Inc.					
4,125 % éch. 15/08/2031		4 000		3 265	0,11
Crown Americas LLC					
4,250 % éch. 30/09/2026		5 000		4 776	0,15
4,750 % éch. 01/02/2026		2 000		1 945	0,06
CrownRock LP					
5,000 % éch. 01/05/2029		2 000		1 808	0,06
5,625 % éch. 15/10/2025		5 000		4 835	0,16
CSC Holdings LLC					
3,375 % éch. 15/02/2031		5 000		3 269	0,11
4,125 % éch. 01/12/2030		5 000		3 540	0,11
4,625 % éch. 01/12/2030		2 000		1 110	0,04
5,500 % éch. 15/04/2027		2 000		1 682	0,05
5,750 % éch. 15/01/2030		7 000		3 963	0,13
Curo Group Holdings Corp.					
7,500 % éch. 01/08/2028		4 500		2 105	0,07
DaVita, Inc.					
3,750 % éch. 15/02/2031		7 000		5 240	0,17
4,625 % éch. 01/06/2030		15 000		12 098	0,39
Diamond Offshore Drilling, Inc.					
13,000 % éch. 21/12/2026		44		43	0,00
Diamond Sports Group LLC					
5,375 % éch. 15/08/2026		6 000		713	0,02
Directv Financing LLC					
5,875 % éch. 15/08/2027		12 500		11 207	0,36
DISH DBS Corp.					
5,250 % éch. 01/12/2026		6 750		5 698	0,18
5,750 % éch. 01/12/2028		5 000		4 000	0,13
5,875 % éch. 15/11/2024		5 000		4 656	0,15
7,750 % éch. 01/07/2026		5 000		4 042	0,13
DISH Network Corp.					
11,750 % éch. 15/11/2027		4 250		4 382	0,14
DT Midstream, Inc.					
4,125 % éch. 15/06/2029		5 000		4 305	0,14
4,375 % éch. 15/06/2031		4 000		3 361	0,11
Edgewell Personal Care Co.					
4,125 % éch. 01/04/2029		4 000		3 416	0,11
5,500 % éch. 01/06/2028		5 000		4 685	0,15
Elanco Animal Health, Inc.					
6,400 % éch. 28/08/2028		5 000		4 783	0,15
Element Solutions, Inc.					
3,875 % éch. 01/09/2028		5 000		4 258	0,14
Encino Acquisition Partners Holdings LLC					
8,500 % éch. 01/05/2028		3 000		2 746	0,09
Endeavor Energy Resources LP					
5,750 % éch. 30/01/2028		10 000		9 591	0,31
Energizer Holdings, Inc.					
4,375 % éch. 31/03/2029		2 000		1 699	0,05
EnLink Midstream LLC					
5,375 % éch. 01/06/2029		7 500		6 952	0,22
5,625 % éch. 15/01/2028		1 000		954	0,03
6,500 % éch. 01/09/2030		1 750		1 734	0,06
EQM Midstream Partners LP					
4,000 % éch. 01/08/2024		1 871		1 801	0,06
4,500 % éch. 15/01/2029		2 500		2 103	0,07
4,750 % éch. 15/01/2031		3 250		2 663	0,09
6,000 % éch. 01/07/2025		735		711	0,02
6,500 % éch. 01/07/2027		2 000		1 915	0,06
6,500 % éch. 15/07/2048		2 000		1 503	0,05
7,500 % éch. 01/06/2027		1 000		981	0,03
7,500 % éch. 01/06/2030		2 000		1 930	0,06
Fertitta Entertainment LLC					
4,625 % éch. 15/01/2029	$	2 000	$	1 695	0,05
6,750 % éch. 15/01/2030		2 500		2 021	0,07
First Student Bidco, Inc.					
4,000 % éch. 31/07/2029		5 000		4 143	0,13
Ford Motor Co.					
3,250 % éch. 12/02/2032		6 125		4 604	0,15
6,100 % éch. 19/08/2032		4 250		3 932	0,13
Ford Motor Credit Co. LLC					
2,684 % éch. 01/12/2024	€	5 000		5 160	0,17
2,700 % éch. 10/08/2026	$	8 000		6 957	0,22
2,900 % éch. 16/02/2028		5 000		4 136	0,13
2,900 % éch. 10/02/2029		4 000		3 200	0,10
3,375 % éch. 13/11/2025		5 000		4 529	0,15
4,000 % éch. 13/11/2030		12 000		9 874	0,32
4,125 % éch. 17/08/2027		5 000		4 486	0,14
4,134 % éch. 04/08/2025		6 000		5 629	0,18
4,542 % éch. 01/08/2026		3 000		2 769	0,09
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC					
5,500 % éch. 01/05/2028		5 000		4 272	0,14
6,500 % éch. 01/10/2025		3 000		2 826	0,09
Frontier Communications Holdings LLC					
5,000 % éch. 01/05/2028		2 500		2 185	0,07
5,875 % éch. 15/10/2027		3 000		2 792	0,09
6,750 % éch. 01/05/2029		3 000		2 486	0,08
Gap, Inc.					
3,625 % éch. 01/10/2029		3 500		2 474	0,08
3,875 % éch. 01/10/2031		4 000		2 796	0,09
Gartner, Inc.					
3,625 % éch. 15/06/2029		4 000		3 520	0,11
3,750 % éch. 01/10/2030		2 000		1 727	0,06
4,500 % éch. 01/07/2028		2 000		1 868	0,06
Genesis Energy LP					
6,250 % éch. 15/05/2026		2 000		1 833	0,06
6,500 % éch. 01/10/2025		2 000		1 915	0,06
Global Medical Response, Inc.					
6,500 % éch. 01/10/2025		10 000		7 173	0,23
Go Daddy Operating Co. LLC					
3,500 % éch. 01/03/2029		5 000		4 192	0,13
GoTo Group, Inc.					
5,500 % éch. 01/09/2027		2 000		1 079	0,03
Graphic Packaging International LLC					
2,625 % éch. 01/02/2029	€	1 000		937	0,03
3,500 % éch. 01/03/2029	$	2 500		2 140	0,07
Greystar Real Estate Partners LLC					
5,750 % éch. 01/12/2025		6 000		5 874	0,19
H-Food Holdings LLC					
8,500 % éch. 01/06/2026		5 000		2 908	0,09
HAT Holdings LLC					
3,375 % éch. 15/06/2026		2 000		1 740	0,06
3,750 % éch. 15/09/2030		3 000		2 210	0,07
HealthEquity, Inc.					
4,500 % éch. 01/10/2029		2 000		1 750	0,06
Hertz Corp.					
4,625 % éch. 01/12/2026		2 000		1 678	0,05
5,000 % éch. 01/12/2029		3 000		2 280	0,07
Hilton Domestic Operating Co., Inc.					
3,625 % éch. 15/02/2032		5 000		4 013	0,13
3,750 % éch. 01/05/2029		3 500		3 032	0,10
4,000 % éch. 01/05/2031		3 000		2 516	0,08
4,875 % éch. 15/01/2030		3 000		2 724	0,09
5,750 % éch. 01/05/2028		1 500		1 458	0,05
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC					
4,875 % éch. 01/07/2031		5 000		4 087	0,13
5,000 % éch. 01/06/2029		4 000		3 445	0,11
Hilton Worldwide Finance LLC					
4,875 % éch. 01/04/2027		2 500		2 384	0,08
Hologic, Inc.					
3,250 % éch. 15/02/2029		4 000		3 441	0,11
4,625 % éch. 01/02/2028		5 000		4 723	0,15
Howard Hughes Corp.					
4,125 % éch. 01/02/2029		4 000		3 356	0,11
4,375 % éch. 01/02/2031		3 000		2 432	0,08
5,375 % éch. 01/08/2028		1 000		903	0,03
Howmet Aerospace, Inc.					
5,950 % éch. 01/02/2037		3 000		2 917	0,09

Tableau des investissements Fonds Global High Yield Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
iHeartCommunications, Inc.				
4,750 % éch. 15/01/2028	$	5 000	$ 4 080	0,13
5,250 % éch. 15/08/2027		3 000	2 546	0,08
Imola Merger Corp.				
4,750 % éch. 15/05/2029		7 500	6 522	0,21
IQVIA, Inc.				
2,250 % éch. 15/01/2028	€	10 000	9 419	0,30
2,250 % éch. 15/03/2029		5 900	5 328	0,17
2,875 % éch. 15/06/2028		7 000	6 686	0,22
5,000 % éch. 15/05/2027	$	2 000	1 911	0,06
Jeld-Wen, Inc.				
4,625 % éch. 15/12/2025		3 000	2 517	0,08
4,875 % éch. 15/12/2027		2 500	1 886	0,06
6,250 % éch. 15/05/2025		2 000	1 885	0,06
Kaiser Aluminum Corp.				
4,500 % éch. 01/06/2031		2 000	1 610	0,05
4,625 % éch. 01/03/2028		4 000	3 497	0,11
KFC Holding Co.				
4,750 % éch. 01/06/2027		3 500	3 366	0,11
Kinetik Holdings LP				
5,875 % éch. 15/06/2030		3 000	2 817	0,09
LABL, Inc.				
5,875 % éch. 01/11/2028		2 500	2 183	0,07
6,750 % éch. 15/07/2026		5 000	4 721	0,15
Lamb Weston Holdings, Inc.				
4,125 % éch. 31/01/2030		2 000	1 769	0,06
4,875 % éch. 15/05/2028		2 000	1 899	0,06
Legacy LifePoint Health LLC				
4,375 % éch. 15/02/2027		4 000	3 390	0,11
Legends Hospitality Holding Co. LLC				
5,000 % éch. 01/02/2026		1 750	1 560	0,05
Lehman Brothers Holdings, Inc.				
0,000 % éch. 25/05/2010 ^		14 200	53	0,00
Level 3 Financing, Inc.				
3,625 % éch. 15/01/2029		2 000	1 468	0,05
3,750 % éch. 15/07/2029		3 000	2 162	0,07
4,250 % éch. 01/07/2028		5 000	3 950	0,13
LFS Topco LLC				
5,875 % éch. 15/10/2026		2 500	2 021	0,07
Live Nation Entertainment, Inc.				
6,500 % éch. 15/05/2027		4 000	3 922	0,13
Madison IAQ LLC				
4,125 % éch. 30/06/2028		8 000	6 700	0,22
5,875 % éch. 30/06/2029		4 000	2 749	0,09
Marriott Ownership Resorts, Inc.				
4,500 % éch. 15/06/2029		2 000	1 662	0,05
6,125 % éch. 15/09/2025		501	516	0,02
Mattel, Inc.				
3,750 % éch. 01/04/2029		3 000	2 639	0,08
5,875 % éch. 15/12/2027		5 000	4 913	0,16
Mauser Packaging Solutions Holding Co.				
4,750 % éch. 15/04/2024	€	5 000	5 153	0,17
Medline Borrower LP				
3,875 % éch. 01/04/2029	$	10 000	8 077	0,26
5,250 % éch. 01/10/2029		8 750	6 965	0,22
MGM Resorts International				
4,625 % éch. 01/09/2026		5 000	4 591	0,15
5,750 % éch. 15/06/2025		1 000	973	0,03
Michaels Cos., Inc.				
5,250 % éch. 01/05/2028		3 750	3 022	0,10
Midcap Financial Issuer Trust				
6,500 % éch. 01/05/2028		4 000	3 446	0,11
Midwest Gaming Borrower LLC				
4,875 % éch. 01/05/2029		6 000	5 113	0,16
Moog, Inc.				
4,250 % éch. 15/12/2027		4 000	3 707	0,12
MPH Acquisition Holdings LLC				
5,500 % éch. 01/09/2028		5 000	3 911	0,13
5,750 % éch. 01/11/2028 (h)		5 000	3 336	0,11
MPT Operating Partnership LP				
2,500 % éch. 24/03/2026	£	2 125	2 036	0,07
3,500 % éch. 15/03/2031	$	3 000	2 063	0,07
MSCI, Inc.				
3,250 % éch. 15/08/2033		1 000	774	0,02
3,875 % éch. 15/02/2031		2 500	2 083	0,07
4,000 % éch. 15/11/2029		5 000	4 364	0,14
Nabors Industries, Inc.				
7,375 % éch. 15/05/2027	$	2 750	$ 2 667	0,09
9,000 % éch. 01/02/2025		1 125	1 141	0,04
Nationstar Mortgage Holdings, Inc.				
5,500 % éch. 15/08/2028		5 000	4 085	0,13
NCR Corp.				
5,000 % éch. 01/10/2028		4 000	3 417	0,11
5,250 % éch. 01/10/2030		2 500	2 067	0,07
5,750 % éch. 01/09/2027		3 750	3 594	0,12
6,125 % éch. 01/09/2029		2 000	1 873	0,06
Nexstar Media, Inc.				
4,750 % éch. 01/11/2028		4 000	3 466	0,11
5,625 % éch. 15/07/2027		4 000	3 678	0,12
NextEra Energy Operating Partners LP				
4,250 % éch. 15/07/2024		2 000	1 943	0,06
4,250 % éch. 15/09/2024		262	245	0,01
4,500 % éch. 15/09/2027		3 000	2 757	0,09
Novelis Corp.				
3,250 % éch. 15/11/2026		3 000	2 693	0,09
3,875 % éch. 15/08/2031		8 000	6 542	0,21
4,750 % éch. 30/01/2030		7 000	6 222	0,20
NRG Energy, Inc.				
3,375 % éch. 15/02/2029		4 250	3 434	0,11
3,625 % éch. 15/02/2031		3 750	2 858	0,09
3,875 % éch. 15/02/2032		5 000	3 765	0,12
6,625 % éch. 15/01/2027		1 067	1 060	0,03
NSG Holdings LLC				
7,750 % éch. 15/12/2025		791	770	0,02
NuStar Logistics LP				
5,750 % éch. 01/10/2025		2 500	2 408	0,08
6,375 % éch. 01/10/2030		2 000	1 853	0,06
Occidental Petroleum Corp.				
5,550 % éch. 15/03/2026		1 000	998	0,03
6,200 % éch. 15/03/2040		5 000	4 902	0,16
6,375 % éch. 01/09/2028		3 000	3 033	0,10
6,450 % éch. 15/09/2036		5 000	5 111	0,16
6,600 % éch. 15/03/2046		1 000	1 031	0,03
6,625 % éch. 01/09/2030		5 000	5 178	0,17
7,500 % éch. 01/05/2031		1 000	1 070	0,03
8,875 % éch. 15/07/2030		5 625	6 360	0,20
Olympus Water U.S. Holding Corp.				
3,875 % éch. 01/10/2028	€	10 000	8 697	0,28
4,250 % éch. 01/10/2028	$	2 000	1 626	0,05
5,375 % éch. 01/10/2029	€	10 000	7 783	0,25
ON Semiconductor Corp.				
3,875 % éch. 01/09/2028	$	3 500	3 060	0,10
OneMain Finance Corp.				
3,500 % éch. 15/01/2027		5 000	4 146	0,13
5,375 % éch. 15/11/2029		5 000	4 098	0,13
6,125 % éch. 15/03/2024		3 000	2 909	0,09
6,625 % éch. 15/01/2028		2 000	1 845	0,06
6,875 % éch. 15/03/2025		5 000	4 815	0,16
7,125 % éch. 15/03/2026		2 000	1 906	0,06
Organon & Co.				
2,875 % éch. 30/04/2028	€	7 500	7 034	0,23
4,125 % éch. 30/04/2028	$	3 000	2 661	0,09
5,125 % éch. 30/04/2031		6 000	5 206	0,17
Outfront Media Capital LLC				
4,250 % éch. 15/01/2029		2 500	2 078	0,07
4,625 % éch. 15/03/2030		2 000	1 658	0,05
5,000 % éch. 15/08/2027		3 000	2 705	0,09
6,250 % éch. 15/06/2025		2 000	1 984	0,06
Owens & Minor, Inc.				
6,625 % éch. 01/04/2030		3 750	3 228	0,10
Oxford Finance LLC				
6,375 % éch. 01/02/2027		4 000	3 728	0,12
Pactiv Evergreen Group Issuer LLC				
4,375 % éch. 15/10/2028		3 000	2 684	0,09
Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc.				
4,000 % éch. 15/10/2027		10 000	8 887	0,29
Park Intermediate Holdings LLC				
4,875 % éch. 15/05/2029		3 000	2 543	0,08
7,500 % éch. 01/06/2025		1 000	1 001	0,03
Park River Holdings, Inc.				
5,625 % éch. 01/02/2029		4 000	2 669	0,09
6,750 % éch. 01/08/2029		2 000	1 375	0,04
PDC Energy, Inc.				
5,750 % éch. 15/05/2026		2 000	1 912	0,06
PennyMac Financial Services, Inc.				
4,250 % éch. 15/02/2029	$	7 500	$ 5 860	0,19
5,750 % éch. 15/09/2031		2 000	1 589	0,05
Performance Food Group, Inc.				
4,250 % éch. 01/08/2029		3 000	2 603	0,08
5,500 % éch. 15/10/2027		5 000	4 726	0,15
6,875 % éch. 01/05/2025		1 500	1 506	0,05
Permian Resources Operating LLC				
5,375 % éch. 15/01/2026		2 000	1 824	0,06
6,875 % éch. 01/04/2027		4 000	3 780	0,12
PetSmart, Inc.				
4,750 % éch. 15/02/2028		12 000	10 887	0,35
7,750 % éch. 15/02/2029		6 000	5 646	0,18
Post Holdings, Inc.				
4,500 % éch. 15/09/2031		1 864	1 570	0,05
4,625 % éch. 15/04/2030		5 000	4 324	0,14
5,500 % éch. 15/12/2029		5 000	4 535	0,15
5,625 % éch. 15/01/2028		5 000	4 714	0,15
Premier Entertainment Sub LLC				
5,625 % éch. 01/09/2029		5 000	3 694	0,12
Prime Security Services Borrower LLC				
3,375 % éch. 31/08/2027		5 000	4 324	0,14
5,250 % éch. 15/04/2024		2 000	1 968	0,06
5,750 % éch. 15/04/2026		4 000	3 859	0,12
6,250 % éch. 15/01/2028		5 000	4 561	0,15
Radiate Holdco LLC				
4,500 % éch. 15/09/2026		4 000	2 945	0,09
6,500 % éch. 15/09/2028		4 000	1 683	0,05
Range Resources Corp.				
4,750 % éch. 15/02/2030		2 000	1 765	0,06
8,250 % éch. 15/01/2029		2 000	2 064	0,07
RHP Hotel Properties LP				
4,500 % éch. 15/02/2029		7 500	6 479	0,21
4,750 % éch. 15/10/2027		4 000	3 626	0,12
RLJ Lodging Trust LP				
4,000 % éch. 15/09/2029		5 000	4 061	0,13
Rockcliff Energy LLC				
5,500 % éch. 15/10/2029		5 000	4 581	0,15
Rocket Mortgage LLC				
3,625 % éch. 01/03/2029		1 750	1 390	0,04
3,875 % éch. 01/03/2031		3 000	2 297	0,07
4,000 % éch. 15/10/2033		2 000	1 497	0,05
Rockies Express Pipeline LLC				
3,600 % éch. 15/05/2025		1 500	1 419	0,05
4,800 % éch. 15/05/2030		2 000	1 763	0,06
4,950 % éch. 15/07/2029		4 000	3 602	0,12
Sabre GLBL, Inc.				
7,375 % éch. 01/09/2025		2 000	1 925	0,06
11,250 % éch. 15/12/2027		2 280	2 349	0,08
SBA Communications Corp.				
3,125 % éch. 01/02/2029		7 000	5 833	0,19
3,875 % éch. 15/02/2027		7 000	6 336	0,20
SCIH Salt Holdings, Inc.				
4,875 % éch. 01/05/2028		5 000	4 300	0,14
6,625 % éch. 01/05/2029		3 000	2 420	0,08
Scripps Escrow, Inc.				
5,875 % éch. 15/07/2027		5 000	4 470	0,14
Select Medical Corp.				
6,250 % éch. 15/08/2026		2 000	1 906	0,06
Sensata Technologies, Inc.				
3,750 % éch. 15/02/2031		6 000	4 945	0,16
Silgan Holdings, Inc.				
2,250 % éch. 01/06/2028	€	5 750	5 242	0,17
Sinclair Television Group, Inc.				
4,125 % éch. 01/12/2030	$	5 000	3 755	0,12
Sirius XM Radio, Inc.				
3,875 % éch. 01/09/2031		2 000	1 564	0,05
4,000 % éch. 15/07/2028		8 000	6 978	0,22
5,000 % éch. 01/08/2027		5 000	4 633	0,15
SM Energy Co.				
6,500 % éch. 15/07/2028		2 000	1 920	0,06
6,625 % éch. 15/01/2027		3 000	2 894	0,09
Southwestern Energy Co.				
5,375 % éch. 01/02/2029		5 000	4 643	0,15
5,375 % éch. 15/03/2030		5 000	4 570	0,15
Spectrum Brands, Inc.				
3,875 % éch. 15/03/2031		3 000	2 337	0,08

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,000 % éch. 01/10/2026	€	2 000	$ 2 014	0,06
5,000 % éch. 01/10/2029	$	2 000	1 734	0,06
5,750 % éch. 15/07/2025		480	475	0,02
Spirit AeroSystems, Inc.				
7,500 % éch. 15/04/2025		3 000	2 971	0,10
9,375 % éch. 30/11/2029		3 000	3 162	0,10
Sprint Capital Corp.				
8,750 % éch. 15/03/2032		10 000	11 924	0,38
Sprint LLC				
7,625 % éch. 15/02/2025		10 000	10 345	0,33
SRS Distribution, Inc.				
4,625 % éch. 01/07/2028		7 000	6 214	0,20
6,000 % éch. 01/12/2029		2 500	1 993	0,06
6,125 % éch. 01/07/2029		5 000	4 049	0,13
Standard Industries, Inc.				
2,250 % éch. 21/11/2026	€	20 000	18 343	0,59
3,375 % éch. 15/01/2031	$	4 000	3 018	0,10
4,375 % éch. 15/07/2030		2 500	2 043	0,07
4,750 % éch. 15/01/2028		5 000	4 507	0,15
Staples, Inc.				
7,500 % éch. 15/04/2026		5 000	4 314	0,14
Station Casinos LLC				
4,500 % éch. 15/02/2028		3 000	2 613	0,08
Suburban Propane Partners LP				
5,000 % éch. 01/06/2031		5 000	4 256	0,14
Summer BC Bidco LLC				
5,500 % éch. 31/10/2026		5 000	4 063	0,13
Syneos Health, Inc.				
3,625 % éch. 15/01/2029		5 000	3 988	0,13
Tallgrass Energy Partners LP				
5,500 % éch. 15/01/2028		5 000	4 442	0,14
6,000 % éch. 31/12/2030		1 000	866	0,03
7,500 % éch. 01/10/2025		2 000	2 021	0,07
Team Health Holdings, Inc.				
6,375 % éch. 01/02/2025 (h)		7 000	4 045	0,13
TEGNA, Inc.				
4,625 % éch. 15/03/2028		3 000	2 853	0,09
4,750 % éch. 15/03/2026		2 000	1 943	0,06
5,000 % éch. 15/09/2029		5 000	4 755	0,15
Tenet Healthcare Corp.				
4,375 % éch. 15/01/2030		6 750	5 854	0,19
4,625 % éch. 15/06/2028		5 000	4 482	0,14
4,875 % éch. 01/01/2026		2 000	1 895	0,06
5,125 % éch. 01/11/2027		5 000	4 661	0,15
6,125 % éch. 01/10/2028		10 000	8 974	0,29
6,125 % éch. 15/06/2030		5 000	4 773	0,15
TerraForm Power Operating LLC				
4,750 % éch. 15/01/2030		1 500	1 308	0,04
5,000 % éch. 31/01/2028		6 500	5 861	0,19
TK Elevator U.S. Newco, Inc.				
5,250 % éch. 15/07/2027		3 950	3 514	0,11
TransDigm, Inc.				
4,625 % éch. 15/01/2029		8 000	7 048	0,23
5,500 % éch. 15/11/2027		8 000	7 529	0,24
6,250 % éch. 15/03/2026		6 000	5 930	0,19
Travel + Leisure Co.				
4,625 % éch. 01/03/2030		5 000	4 155	0,13
6,625 % éch. 31/07/2026		4 000	3 920	0,13
TriNet Group, Inc.				
3,500 % éch. 01/03/2029		5 000	4 117	0,13
Triumph Group, Inc.				
8,875 % éch. 01/06/2024		1 931	1 968	0,06
Twilio, Inc.				
3,625 % éch. 15/03/2029		4 000	3 255	0,10
3,875 % éch. 15/03/2031		3 000	2 384	0,08
U.S. Foods, Inc.				
4,625 % éch. 01/06/2030		2 250	1 984	0,06
4,750 % éch. 15/02/2029	$	7 000	$ 6 224	0,20
6,250 % éch. 15/04/2025		5 000	4 956	0,16
Uber Technologies, Inc.				
4,500 % éch. 15/08/2029		7 000	6 112	0,20
United Airlines, Inc.				
4,375 % éch. 15/04/2026		4 000	3 715	0,12
4,625 % éch. 15/04/2029		10 000	8 725	0,28
Univision Communications, Inc.				
4,500 % éch. 01/05/2029		8 000	6 705	0,22
5,125 % éch. 15/02/2025		4 000	3 818	0,12
6,625 % éch. 01/06/2027		5 000	4 835	0,16
Venture Global Calcasieu Pass LLC				
3,875 % éch. 15/08/2029		3 250	2 849	0,09
3,875 % éch. 01/11/2033		2 500	2 047	0,07
4,125 % éch. 15/08/2031		3 350	2 860	0,09
Vertiv Group Corp.				
4,125 % éch. 15/11/2028		9 000	7 661	0,25
ViaSat, Inc.				
5,625 % éch. 15/09/2025		3 000	2 788	0,09
5,625 % éch. 15/04/2027		825	751	0,02
6,500 % éch. 15/07/2028		3 000	2 256	0,07
Victoria's Secret & Co.				
4,625 % éch. 15/07/2029		4 000	3 146	0,10
WESCO Distribution, Inc.				
7,250 % éch. 15/06/2028		7 500	7 614	0,25
Western Midstream Operating LP				
5,450 % éch. 01/04/2044		2 250	1 873	0,06
5,500 % éch. 01/02/2050		7 000	5 779	0,19
White Cap Buyer LLC				
6,875 % éch. 15/10/2028		7 375	6 391	0,21
White Cap Parent LLC (8,250 % en numéraire ou 8,250 % de rémunération en nature)				
8,250 % éch. 15/03/2026 (a)		3 000	2 597	0,08
WMG Acquisition Corp.				
2,250 % éch. 15/08/2031	€	3 500	2 937	0,09
2,750 % éch. 15/07/2028		2 500	2 419	0,08
3,875 % éch. 15/07/2030	$	5 000	4 316	0,14
WR Grace Holdings LLC				
4,875 % éch. 15/06/2027		5 000	4 437	0,14
5,625 % éch. 15/08/2029		3 000	2 429	0,08
WW International, Inc.				
4,500 % éch. 15/04/2029		2 500	1 252	0,04
Wyndham Hotels & Resorts, Inc.				
4,375 % éch. 15/08/2028		5 000	4 494	0,14
Wynn Las Vegas LLC				
4,250 % éch. 30/05/2023		2 500	2 468	0,08
5,250 % éch. 15/05/2027		5 000	4 520	0,15
5,500 % éch. 01/03/2025		2 000	1 903	0,06
Yum! Brands, Inc.				
3,625 % éch. 15/03/2031		5 000	4 203	0,14
4,625 % éch. 31/01/2032		1 000	886	0,03
6,875 % éch. 15/11/2037		2 000	2 034	0,07
Zayo Group Holdings, Inc.				
4,000 % éch. 01/03/2027		5 000	3 704	0,12
6,125 % éch. 01/03/2028		3 000	1 708	0,06
ZoomInfo Technologies LLC				
3,875 % éch. 01/02/2029		5 000	4 208	0,14
			1 550 455	49,97
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				
8,165 % éch. 16/11/2025		4 327	4 089	0,13
Team Health Holdings, Inc.				
7,134 % éch. 06/02/2024		8 789	7 559	0,24
U.S. Renal Care, Inc.				
9,438 % éch. 26/06/2026		9 675	5 460	0,18
			17 108	0,55

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Bear Stearns ALT-A Trust			
3,734 % éch. 25/03/2036 ^	$ 46	$ 36	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust			
5,500 % éch. 25/11/2035 ^	1 126	710	0,03
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust			
4,649 % éch. 19/10/2036 ^	354	210	0,01
HarborView Mortgage Loan Trust			
4,599 % éch. 19/03/2037	79	70	0,00
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust			
4,307 % éch. 25/02/2036 ^	88	75	0,00
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
2,888 % éch. 25/05/2047 ^	29	4	0,00
3,018 % éch. 25/05/2046 ^	74	58	0,00
		1 163	0,04
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Billets du Trésor américain			
3,500 % éch. 15/09/2025	40 000	39 206	1,26
3,875 % éch. 30/11/2027	90 700	90 219	2,91
4,125 % éch. 30/09/2027	20 000	20 077	0,65
4,125 % éch. 31/10/2027	78 000	78 292	2,52
4,250 % éch. 15/10/2025	58 000	57 964	1,87
		285 758	9,21
Total États-Unis		1 854 484	59,77
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
4,444 % éch. 21/03/2023 (b)(c)	95 000	94 142	3,04
Total des Instruments à court terme		94 142	3,04
Total des Valeurs mobilières		**$ 2 850 786**	**91,88**

	ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (e)	1 219 084	11 130	0,36
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (e)	3 637 652	38 357	1,24
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	15 279 896	152 096	4,90
Total des Fonds d'investissement		**$ 201 583**	**6,50**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
FICC	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 7 812	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 29/06/2023	$ (7 968)	$ 7 812	$ 7 813	0,25
NOM	4,320	30/12/2022	03/01/2023	3 600	Obligations du Trésor américain 3,000 % échéance 15/11/2044	(3 674)	3 600	3 602	0,12
Total des Contrats de mise en pension						**$ (11 642)**	**$ 11 412**	**$ 11 415**	**0,37**

(1) Comprend les intérêts courus.

Tableau des investissements Fonds Global High Yield Bond Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Court	03/2023	750	$ 933	0,03
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ 933**	**0,03**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION(1)

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel(2)	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.HY-38 à 5 ans	5,000 %	20/06/2027	$ 99 000	$ 1 853	0,06
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000	20/12/2027	100 000	1 438	0,04
				$ 3 291	0,10
Total des Instruments financiers dérivés compensés				**$ 3 291**	**0,10**

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 1 917	€ 1 818	$ 24	$ 0	$ 24	0,00
BRC	01/2023	20 530	19 232	4	0	4	0,00
CBK	01/2023	€ 323	$ 343	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 2 370	€ 2 229	10	0	10	0,00
JPM	01/2023	£ 31 141	$ 37 604	138	0	138	0,01
MBC	01/2023	€ 26 196	27 459	0	(511)	(511)	(0,02)
	01/2023	£ 1 827	2 227	29	0	29	0,00
	01/2023	$ 4 745	€ 4 459	16	0	16	0,00
	02/2023	CAD 2 287	$ 1 726	37	0	37	0,00
MYI	01/2023	€ 3 277	3 495	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	£ 751	904	0	0	0	0,00
	01/2023	SGD 5	4	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 230	€ 216	1	0	1	0,00
	01/2023	5 122	£ 4 249	0	(11)	(11)	0,00
	01/2023	2	SGD 3	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	€ 726 482	$ 756 158	0	(19 510)	(19 510)	(0,63)
				$ 259	$ (20 035)	$ (19 776)	(0,64)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation et Institutions en CHF :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 11 631	CHF 11 000	$ 266	$ 0	$ 266	0,01
CBK	01/2023	20 138	19 025	439	0	439	0,01
MBC	01/2023	CHF 82	$ 89	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 44	CHF 40	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	CHF 3 594	$ 3 852	0	(35)	(35)	0,00
SCX	01/2023	$ 16	CHF 15	0	0	0	0,00
				$ 705	$ (35)	$ 670	0,02

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	44	€	42	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
BPS	01/2023	€	543	$	579	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01/2023		2 769		2 939	0	(18)	(18)	0,00
	01/2023	$	377 863	€	364 447	11 258	0	11 258	0,36
MBC	01/2023	€	4 014	$	4 270	0	(16)	(16)	0,00
	01/2023	$	425 626	€	406 074	7 941	0	7 941	0,26
SCX	01/2023		402 913		387 100	10 396	0	10 396	0,33
						$ 29 596	$ (35)	$ 29 561	0,95

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution et E en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£	39 627	$	48 930	$ 1 256	$ 0	$ 1 256	0,04
	01/2023	$	482	£	400	0	(1)	(1)	0,00
BPS	01/2023	£	60	$	72	0	0	0	0,00
BRC	01/2023		4 265		5 137	5	0	5	0,00
	01/2023	$	584	£	486	0	0	0	0,00
JPM	01/2023		150 875		124 945	0	(554)	(554)	(0,02)
MBC	01/2023	£	932	$	1 138	17	0	17	0,00
	01/2023	$	150 808	£	125 730	610	(154)	456	0,02
MYI	01/2023	£	205	$	253	6	0	6	0,00
	01/2023	$	554	£	453	0	(10)	(10)	0,00
TOR	01/2023		150 004		124 765	100	0	100	0,00
UAG	01/2023	£	136	$	169	5	0	5	0,00
						$ 1 999	$ (719)	$ 1 280	0,04

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en SGD (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	SGD	7	$	5	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BOA	01/2023	$	1 464	SGD	2 009	34	0	34	0,01
BPS	01/2023		1 461		2 005	34	0	34	0,00
BRC	01/2023		1		2	0	0	0	0,00
GLM	01/2023		182		247	3	0	3	0,00
MBC	01/2023	SGD	37	$	28	0	0	0	0,00
	01/2023	$	1 589	SGD	2 172	31	0	31	0,00
RBC	01/2023		15		20	0	0	0	0,00
RYL	01/2023		23		31	0	0	0	0,00
SCX	01/2023		1		1	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	SGD	10	$	7	0	0	0	0,00
	01/2023	$	14	SGD	19	0	0	0	0,00
						$ 102	$ 0	$ 102	0,01

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ 11 837**	**0,38**
Total des Investissements	**$ 3 079 842**	**99,26**
Autres actifs et passifs à court terme	**$ 23 026**	**0,74**
Actif net	**$ 3 102 868**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* **Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

^ **Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.**

(a) **Titre à rémunération en nature.**

(b) **Titre à coupon zéro.**

(c) **Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.**

(d) **Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.**

(e) **Affilié au Fonds.**

(f) **Titre convertible conditionnel.**

(g) **Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,49 %) :**

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Diamond Foreign Asset Co. (9,000 % en numéraire ou 9,000 % de rémunération en nature)	9,000 %	22/04/2027	12/05/2021	$ 66	$ 62	0,00

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 10 952 $ (31 décembre 2021 : 15 991 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 205 $ (31 décembre 2021 : 0 $) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 20 021 $ (31 décembre 2021 : 18 614 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un titre d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 22 $) et un montant en numéraire de 8 590 $ (31 décembre 2021 : 2 700 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 2 850 743	$ 43	$ 2 850 786
Fonds d'investissement	201 583	0	0	201 583
Contrats de mise en pension	0	11 412	0	11 412
Instruments financiers dérivés[3]	933	15 128	0	16 061
Totaux	**$ 202 516**	**$ 2 877 283**	**$ 43**	**$ 3 079 842**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 4 998	$ 4 666 725	$ 11 498	$ 4 683 221
Fonds d'investissement	417 716	0	0	417 716
Instruments financiers dérivés[3]	0	24 073	0	24 073
Totaux	**$ 422 714**	**$ 4 690 798**	**$ 11 498**	**$ 5 125 010**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	En % de l'actif net
BRC	(2,000) %	16/12/2022	TBD(1)	$ (1 281)	$ (1 280)	(0,04)
	(0,500)	16/12/2022	TBD(1)	(596)	(596)	(0,02)
	(0,250)	21/09/2022	TBD(1)	€ (1 606)	(1 713)	(0,06)
	0,600	23/05/2022	TBD(1)	£ (1 620)	(1 927)	(0,06)
FBF	2,500	16/12/2022	TBD(1)	$ (2 416)	(2 419)	(0,08)
JML	(1,000)	24/06/2022	TBD(1)	£ (2 068)	(2 462)	(0,08)
Total des Contrats de prise en pension					**$ (10 397)**	**(0,34)**

(1) Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ 1 580	$ (1 340)	$ 240	$ (54)	$ 0	$ (54)
BPS	33	0	33	(254)	0	(254)
BRC	9	0	9	369	0	369
CBK	11 688	(11 530)	158	(53)	0	(53)
GLM	3	(10)	(7)	142	(130)	12
HUS	S/O	S/O	S/O	(176)	0	(176)
JPM	(416)	50	(366)	5 256	(4 300)	956
MBC	8 000	(7 460)	540	S/O	S/O	S/O
MYC	S/O	S/O	S/O	739	(710)	29
MYI	(51)	0	(51)	149	82	231
RBC	S/O	S/O	S/O	5 747	(4 620)	1 127
SCX	(9 114)	8 540	(574)	12 491	(8 950)	3 541
TOR	100	(180)	(80)	(4 226)	2 640	(1 586)
UAG	5	0	5	4 923	(3 590)	1 333

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	49,58	45,83
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	42,29	44,25
Autres valeurs mobilières	0,01	0,53
Fonds d'investissement	6,50	8,08
Contrats de mise en pension	0,37	S/O
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,03	S/O
Instruments financiers dérivés compensés	0,10	(0,02)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,38	0,48
Contrats de prise en pension	(0,34)	(0,31)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Belgique	0,22	0,25
Bermudes	0,40	0,33
Canada	1,55	2,27
Îles Caïmans	0,78	0,65
Danemark	0,09	S/O
France	1,95	2,26
Allemagne	2,67	3,19
Irlande	0,22	0,26
Italie	3,75	3,55
Jersey, Îles Anglo-normandes	0,20	0,19
Liberia	0,67	0,19
Luxembourg	2,47	2,65
Île Maurice	S/O	0,13
Multinationales	1,67	1,82
Pays-Bas	5,00	4,22
Norvège	0,34	0,23
Panama	0,53	0,65
Espagne	1,70	1,19
Suède	0,91	0,85
Suisse	0,11	0,10
Royaume-Uni	3,84	4,19
États-Unis	59,77	59,85
Instruments à court terme	3,04	1,59
Fonds d'investissement	6,50	8,08
Contrats de mise en pension	0,37	S/O
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,03	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,10	(0,02)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Swaps de rendement total sur indices	S/O	0,02
Contrats de change à terme	(0,64)	(0,23)
Contrats de change à terme couverts	1,02	0,69
Autres actifs et passifs à court terme	0,74	0,85
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
AUSTRALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Boral Finance Pty. Ltd.				
3,750 % éch. 01/05/2028	$	415	$ 371	0,00
CIMIC Finance Ltd.				
1,500 % éch. 28/05/2029	€	4 300	3 463	0,03
GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.				
1,900 % éch. 14/12/2028	AUD	23 500	12 716	0,12
GTA Finance Co. Pty. Ltd.				
2,200 % éch. 26/08/2027		7 200	4 140	0,04
Lendlease Finance Ltd.				
3,400 % éch. 27/10/2027		9 900	5 860	0,06
Macquarie University				
3,500 % éch. 07/09/2028		250	154	0,00
Optus Finance Pty. Ltd.				
1,000 % éch. 20/06/2029	€	6 800	5 919	0,06
Pacific National Finance Pty. Ltd.				
4,750 % éch. 22/03/2028	$	15 900	14 121	0,13
Qantas Airways Ltd.				
3,150 % éch. 27/09/2028	AUD	500	286	0,00
Santos Finance Ltd.				
4,125 % éch. 14/09/2027	$	7 800	7 055	0,07
5,250 % éch. 13/03/2029		21 600	19 843	0,19
Woodside Finance Ltd.				
3,700 % éch. 15/03/2028		600	543	0,01
4,500 % éch. 04/03/2029		26 390	24 793	0,23
			99 264	0,94
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement australien				
1,000 % éch. 21/11/2031	AUD	51 800	27 256	0,26
1,250 % éch. 21/05/2032		24 000	12 763	0,12
4,500 % éch. 21/04/2033		59 700	42 008	0,40
			82 027	0,78
Total Australie			181 291	1,72
AUTRICHE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Erste Group Bank AG				
4,250 % éch. 15/10/2027 (f)(h)	€	17 800	15 109	0,14
5,125 % éch. 15/10/2025 (f)(h)		7 600	7 390	0,07
Total Autriche			22 499	0,21
BELGIQUE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
KBC Group NV				
4,250 % éch. 24/10/2025 (f)(h)		5 000	4 643	0,05
Sofina S.A.				
1,000 % éch. 23/09/2028		9 300	7 762	0,07
Total Belgique			12 405	0,12
BERMUDES				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
MAPS Ltd.				
4,212 % éch. 15/05/2043	$	5 993	5 357	0,05
S-Jets Ltd.				
3,967 % éch. 15/08/2042		12 609	9 802	0,09
START Ltd.				
4,089 % éch. 15/03/2044		3 042	2 600	0,03
			17 759	0,17
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Aircastle Ltd.				
2,850 % éch. 26/01/2028		6 400	5 244	0,05
4,250 % éch. 15/06/2026		3 050	2 872	0,03
Arch Capital Group Ltd.				
3,635 % éch. 30/06/2050		2 760	1 916	0,02
Bacardi Ltd.				
2,750 % éch. 15/07/2026		2 150	1 946	0,02
4,450 % éch. 15/05/2025		10 410	10 110	0,09
4,700 % éch. 15/05/2028	$	26 330	$ 25 188	0,24
Viking Cruises Ltd.				
13,000 % éch. 15/05/2025		4 300	4 544	0,04
			51 820	0,49
Total Bermudes			69 579	0,66
BRÉSIL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Bradesco S.A.				
2,850 % éch. 27/01/2023		300	300	0,00
Banco BTG Pactual S.A.				
4,500 % éch. 10/01/2025		14 200	13 706	0,13
Banco do Brasil S.A.				
4,625 % éch. 15/01/2025		11 763	11 511	0,11
CSN Resources S.A.				
5,875 % éch. 08/04/2032		8 100	6 789	0,06
7,625 % éch. 17/04/2026		1 636	1 635	0,02
Total Brésil			33 941	0,32
CANADA				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Air Canada Pass-Through Trust				
3,300 % éch. 15/07/2031		2 492	2 134	0,02
3,600 % éch. 15/09/2028		5 768	5 214	0,05
3,750 % éch. 15/06/2029		2 746	2 398	0,02
4,125 % éch. 15/11/2026		3 419	3 132	0,03
5,250 % éch. 01/10/2030		3 743	3 542	0,03
Bank of Nova Scotia				
4,900 % éch. 04/06/2025 (f)(h)		21 100	20 282	0,19
Brookfield Finance, Inc.				
3,500 % éch. 30/03/2051		19 100	12 199	0,12
3,900 % éch. 25/01/2028		3 000	2 756	0,03
4,700 % éch. 20/09/2047		2 300	1 859	0,02
4,850 % éch. 29/03/2029		8 834	8 444	0,08
CI Financial Corp.				
4,100 % éch. 15/06/2051		11 350	6 726	0,06
Enbridge, Inc.				
4,250 % éch. 01/12/2026		10 504	10 114	0,10
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
2,750 % éch. 29/03/2028	€	29 600	27 646	0,26
4,850 % éch. 17/04/2028	$	100	95	0,00
			106 541	1,01
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement canadien				
2,750 % éch. 01/12/2048	CAD	500	334	0,00
Province de l'Ontario				
2,050 % éch. 02/06/2030		11 700	7 585	0,07
2,600 % éch. 02/06/2025		151 500	108 060	1,03
Province du Québec				
1,900 % éch. 01/09/2030		4 500	2 876	0,03
			118 855	1,13
Total Canada			225 396	2,14
ÎLES CAÏMANS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd.				
4,213 % éch. 16/12/2041	$	5 528	4 534	0,04
ECAF Ltd.				
4,947 % éch. 15/06/2040		9 227	5 813	0,06
KDAC Aviation Finance Ltd.				
4,212 % éch. 15/12/2042		5 182	3 990	0,04
METAL Cayman LLC				
4,581 % éch. 15/10/2042		12 817	6 736	0,06
Sapphire Aviation Finance Ltd.				
4,250 % éch. 15/03/2040		8 682	6 746	0,07
Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.				
4,212 % éch. 17/05/2032		2 910	2 505	0,02
			30 324	0,29
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Alibaba Group Holding Ltd.				
2,125 % éch. 09/02/2031		4 100	3 274	0,03
4,400 % éch. 06/12/2057	$	8 200	$ 6 304	0,06
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % éch. 18/11/2027		14 256	11 416	0,11
2,875 % éch. 15/02/2025		8 300	7 674	0,07
4,250 % éch. 15/04/2026		3 600	3 268	0,03
4,375 % éch. 01/05/2026		2 310	2 107	0,02
5,500 % éch. 15/01/2026		18 600	17 703	0,17
China Modern Dairy Holdings Ltd.				
2,125 % éch. 14/07/2026		9 400	7 991	0,08
Geely Automobile Holdings Ltd.				
3,625 % éch. 25/01/2023		11 600	11 587	0,11
Goodman HK Finance				
4,375 % éch. 19/06/2024		3 500	3 423	0,03
Melco Resorts Finance Ltd.				
4,875 % éch. 06/06/2025		23 260	21 401	0,20
5,250 % éch. 26/04/2026		17 850	15 736	0,15
5,375 % éch. 04/12/2029		4 727	3 801	0,04
5,625 % éch. 17/07/2027		11 555	9 929	0,10
5,750 % éch. 21/07/2028		2 600	2 178	0,02
MGM China Holdings Ltd.				
5,250 % éch. 18/06/2025		8 300	7 819	0,07
5,375 % éch. 15/05/2024		1 255	1 213	0,01
5,875 % éch. 15/05/2026		6 746	6 310	0,06
Park Aerospace Holdings Ltd.				
4,500 % éch. 15/03/2023		18 490	18 446	0,18
QNB Finance Ltd.				
3,500 % éch. 28/03/2024		14 500	14 206	0,14
Sands China Ltd.				
2,800 % éch. 08/03/2027		1 000	858	0,01
3,350 % éch. 08/03/2029		1 500	1 227	0,01
4,300 % éch. 08/01/2026		3 900	3 604	0,03
5,625 % éch. 08/08/2025		6 800	6 510	0,06
5,900 % éch. 08/08/2028		19 048	17 861	0,17
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.				
3,750 % éch. 23/01/2023 (j)		6 914	6 907	0,07
Tencent Holdings Ltd.				
2,390 % éch. 03/06/2030		11 900	9 702	0,09
3,240 % éch. 03/06/2050		5 200	3 297	0,03
3,290 % éch. 03/06/2060		700	421	0,00
3,975 % éch. 11/04/2029		48 350	44 600	0,42
Tencent Music Entertainment Group				
2,000 % éch. 03/09/2030		2 800	2 121	0,02
Tingyi Cayman Islands Holding Corp.				
1,625 % éch. 24/09/2025		11 500	10 351	0,10
Wynn Macau Ltd.				
4,875 % éch. 01/10/2024		4 635	4 383	0,04
5,500 % éch. 15/01/2026		20 557	18 890	0,18
5,500 % éch. 01/10/2027		2 000	1 751	0,02
Xiaomi Best Time International Ltd.				
2,875 % éch. 14/07/2031		1 900	1 380	0,01
Zhongsheng Group Holdings Ltd.				
3,000 % éch. 13/01/2026		7 100	6 355	0,06
			316 004	3,00
Total Îles Caïmans			346 328	3,29
CHILI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Santander Chile				
2,700 % éch. 10/01/2025		4 100	3 896	0,04
Celeo Redes Operacion Chile S.A.				
5,200 % éch. 22/06/2047		1 524	1 307	0,01
Empresa Electrica Cochrane SpA				
5,500 % éch. 14/05/2027		1 062	984	0,01
Total Chili			6 187	0,06
CHINE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Bank of China Luxembourg S.A.				
0,125 % éch. 16/01/2023	€	11 800	12 585	0,12
State Grid Overseas Investment BVI Ltd.				
0,797 % éch. 05/08/2026		12 223	11 421	0,11
2,125 % éch. 02/05/2030		5 400	4 767	0,04
Total Chine			28 773	0,27

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CHYPRE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Atrium Finance PLC					
2,625 % éch. 05/09/2027	€	12 100	$	9 053	0,09
DANEMARK					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
GN Store Nord A/S					
0,875 % éch. 25/11/2024		13 800		13 266	0,13
Jyske Realkredit A/S					
1,500 % éch. 01/10/2053	DKK	8 879		986	0,01
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab					
1,000 % éch. 01/10/2050		4 155		441	0,00
Nykredit Realkredit A/S					
1,000 % éch. 01/10/2050		102 212		10 812	0,10
1,000 % éch. 01/10/2053		9 456		975	0,01
1,500 % éch. 01/10/2053		7 010		776	0,01
Realkredit Danmark A/S					
1,000 % éch. 01/10/2050		34 516		3 654	0,03
1,000 % éch. 01/10/2053		3 680		361	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		7 018		777	0,01
Total Danemark				32 048	0,30
FINLANDE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Balder Finland Oyj					
1,000 % éch. 20/01/2029	€	14 100		10 081	0,10
Nokia Oyj					
4,375 % éch. 12/06/2027	$	2 800		2 648	0,02
Nordea Bank Abp					
3,750 % éch. 01/03/2029 (f)(h)		4 000		3 098	0,03
SATO Oyj					
1,375 % éch. 24/02/2028	€	6 671		5 170	0,05
Total Finlande				20 997	0,20
FRANCE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Accor S.A.					
2,375 % éch. 29/11/2028		4 500		4 120	0,04
Altarea S.C.A.					
1,750 % éch. 16/01/2030		11 200		8 917	0,08
1,875 % éch. 17/01/2028		5 900		4 900	0,05
BNP Paribas S.A.					
1,675 % éch. 30/06/2027	$	3 700		3 224	0,03
1,904 % éch. 30/09/2028		4 700		3 921	0,04
2,219 % éch. 09/06/2026		23 100		21 229	0,20
2,591 % éch. 20/01/2028		9 800		8 633	0,08
3,500 % éch. 16/11/2027		20 000		18 415	0,17
5,198 % éch. 10/01/2030		15 000		14 285	0,14
7,750 % éch. 16/08/2029 (f)(h)		10 000		9 900	0,09
BPCE S.A.					
2,125 % éch. 13/10/2046 (h)	€	10 000		7 476	0,07
Bureau Veritas S.A.					
1,250 % éch. 07/09/2023		300		319	0,00
1,875 % éch. 06/01/2025		15 400		15 623	0,15
Crédit Agricole S.A.					
4,000 % éch. 23/12/2027 (f)(h)		2 900		2 743	0,03
7,500 % éch. 23/06/2026 (f)(h)	£	5 138		6 013	0,06
Holding d'Infrastructures de Transport SASU					
1,475 % éch. 18/01/2031	€	12 200		10 189	0,10
1,625 % éch. 18/09/2029		3 700		3 249	0,03
Holding d'Infrastructures des Métiers de l'Environnement					
0,625 % éch. 16/09/2028		3 200		2 680	0,03
Indigo Group S.A.S.					
1,625 % éch. 19/04/2028		9 800		9 057	0,09
New Immo Holding S.A.					
2,750 % éch. 26/11/2026		2 800		2 546	0,02
Peugeot Invest					
1,875 % éch. 30/10/2026		18 500		16 233	0,15
SEB S.A.					
1,375 % éch. 16/06/2025	€	6 900	$	6 851	0,06
Société Générale S.A.					
1,488 % éch. 14/12/2026	$	13 400		11 660	0,11
2,889 % éch. 09/06/2032		25 000		19 291	0,18
4,000 % éch. 12/01/2027		2 000		1 855	0,02
TDF Infrastructure SASU					
1,750 % éch. 01/12/2029	€	9 100		7 392	0,07
2,500 % éch. 07/04/2026		7 300		7 132	0,07
Ubisoft Entertainment S.A.					
0,878 % éch. 24/11/2027		18 600		15 404	0,15
1,289 % éch. 30/01/2023		6 500		6 921	0,07
Worldline S.A.					
1,625 % éch. 13/09/2024		9 600		9 873	0,09
				260 051	2,47
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS					
Numericable Group S.A.					
4,605 % éch. 31/07/2025		4 228		4 307	0,04
Total France				264 358	2,51
ALLEMAGNE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Bayer AG					
0,625 % éch. 12/07/2031		1 000		805	0,01
Deutsche Bank AG					
1,625 % éch. 20/01/2027		18 600		17 533	0,17
1,750 % éch. 19/11/2030		40 300		33 874	0,32
2,311 % éch. 16/11/2027	$	2 800		2 378	0,02
2,625 % éch. 16/12/2024	£	15 000		16 778	0,16
3,547 % éch. 18/09/2031	$	12 643		10 163	0,10
3,729 % éch. 14/01/2032 (i)		11 235		8 260	0,08
3,961 % éch. 26/11/2025		600		574	0,01
10,000 % éch. 01/12/2027 (f)(h)	€	3 600		3 982	0,04
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide					
1,625 % éch. 09/07/2024		9 200		9 507	0,09
1,875 % éch. 31/03/2028		8 700		8 019	0,08
2,125 % éch. 09/07/2027		14 700		14 084	0,13
Hamburg Commercial Bank AG					
0,500 % éch. 22/09/2026		100		91	0,00
IHO Verwaltungs GmbH (3,625 % en numéraire ou 4,375 % de rémunération en nature)					
3,625 % éch. 15/05/2025 (b)		300		293	0,00
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % en numéraire ou 4,500 % de rémunération en nature)					
3,750 % éch. 15/09/2026 (b)		19 800		18 432	0,17
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau					
0,375 % éch. 15/03/2023		4 600		4 896	0,05
Sixt SE					
1,750 % éch. 09/12/2024		11 070		11 405	0,11
Volkswagen Bank GmbH					
1,875 % éch. 31/01/2024		7 200		7 532	0,07
Volkswagen Financial Services AG					
0,000 % éch. 12/02/2025 (d)		7 750		7 601	0,07
1,500 % éch. 01/10/2024		4 200		4 296	0,04
Volkswagen Leasing GmbH					
1,125 % éch. 04/04/2024		5 500		5 678	0,05
1,375 % éch. 20/01/2025		2 600		2 629	0,02
1,500 % éch. 19/06/2026		7 500		7 274	0,07
Vonovia SE					
0,250 % éch. 01/09/2028		8 900		7 290	0,07
				203 374	1,93
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
République d'Allemagne					
1,300 % éch. 15/10/2027		5 100		5 143	0,05
Total Allemagne				208 517	1,98
GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Amdocs Ltd.					
2,538 % éch. 15/06/2030	$	5 975		4 850	0,04
Globalworth Real Estate Investments Ltd.					
2,950 % éch. 29/07/2026	€	16 900		14 367	0,14
3,000 % éch. 29/03/2025		1 100		1 030	0,01
Sirius Real Estate Ltd.					
1,125 % éch. 22/06/2026		8 500		7 098	0,07
1,750 % éch. 24/11/2028	€	10 100	$	7 417	0,07
Total Guernesey, Îles Anglo-normandes				34 762	0,33
HONG KONG					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Huarong Finance Co. Ltd.					
2,125 % éch. 30/09/2023	$	17 000		16 363	0,15
Lenovo Group Ltd.					
3,421 % éch. 02/11/2030		6 400		5 085	0,05
				21 448	0,20
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Airport Authority Hong Kong					
2,400 % éch. 08/03/2028 (f)		2 350		2 056	0,02
3,450 % éch. 21/02/2029		5 500		5 110	0,05
				7 166	0,07
Total Hong Kong				28 614	0,27
INDE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Adani Transmission Step-One Ltd.					
4,250 % éch. 21/05/2036		17 661		13 613	0,13
Bharti Airtel Ltd.					
4,375 % éch. 10/06/2025		5 000		4 862	0,05
ReNew Power Pvt Ltd.					
5,875 % éch. 05/03/2027		8 300		7 979	0,07
				26 454	0,25
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Export-Import Bank of India					
3,875 % éch. 01/02/2028		300		279	0,00
Total Inde				26 733	0,25
INDONÉSIE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT					
4,625 % éch. 20/07/2023		2 900		2 891	0,03
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara					
4,000 % éch. 30/06/2050		7 800		5 597	0,05
4,875 % éch. 17/07/2049		700		554	0,01
6,150 % éch. 21/05/2048		2 300		2 189	0,02
				11 231	0,11
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia					
2,800 % éch. 23/06/2030		6 600		5 783	0,05
4,450 % éch. 20/02/2029		800		789	0,01
				6 572	0,06
Total Indonésie				17 803	0,17
IRLANDE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
AerCap Ireland Capital DAC					
1,150 % éch. 29/10/2023		11 310		10 886	0,10
1,650 % éch. 29/10/2024		2 900		2 677	0,03
2,450 % éch. 29/10/2026		3 200		2 802	0,03
2,875 % éch. 14/08/2024		3 300		3 127	0,03
3,150 % éch. 15/02/2024		6 200		5 996	0,06
4,450 % éch. 01/10/2025		400		385	0,00
4,450 % éch. 03/04/2026		5 475		5 232	0,05
4,875 % éch. 16/01/2024		2 400		2 378	0,02
5,003 % éch. 29/09/2023		4 900		4 811	0,05
AIB Group PLC					
4,263 % éch. 10/04/2025		11 300		10 908	0,10
Bank of Ireland Group PLC					
6,000 % éch. 01/09/2025 (f)(h)	€	5 109		5 088	0,05
6,253 % éch. 16/09/2026	$	8 700		8 636	0,08
GE Capital UK Funding Unlimited Co.					
5,875 % éch. 18/01/2033	£	800		979	0,01
Perrigo Finance Unlimited Co.					
4,900 % éch. 15/12/2044	$	5 300		3 592	0,03
SMBC Aviation Capital Finance DAC					
3,550 % éch. 15/04/2024		3 800		3 675	0,04

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,125 % éch. 15/07/2023	$	6 600	$ 6 532	0,06
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.				
5,125 % éch. 23/11/2052	£	3 700	4 048	0,04
Total Irlande			81 752	0,78
ITALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Aeroporti di Roma SpA				
1,625 % éch. 02/02/2029	€	2 400	2 093	0,02
1,750 % éch. 30/07/2031		11 700	9 326	0,09
5,441 % éch. 20/02/2023	£	2 500	3 003	0,03
AMCO - Asset Management Co. SpA				
1,500 % éch. 17/07/2023	€	35 900	37 951	0,36
Atlantia SpA				
1,625 % éch. 03/02/2025		14 100	14 091	0,13
1,875 % éch. 13/07/2027		15 770	14 344	0,14
1,875 % éch. 12/02/2028		1 600	1 424	0,01
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
1,875 % éch. 09/01/2026		27 200	24 969	0,24
2,625 % éch. 28/04/2025		16 100	15 593	0,15
3,625 % éch. 24/09/2024		8 925	9 065	0,09
Intesa Sanpaolo SpA				
4,000 % éch. 23/09/2029	$	10 600	9 090	0,09
5,017 % éch. 26/06/2024		5 900	5 675	0,05
5,710 % éch. 15/01/2026		14 819	14 257	0,13
7,750 % éch. 11/01/2027 (f)(h)	€	22 042	22 755	0,21
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA				
3,500 % éch. 09/10/2025		2 800	2 780	0,03
UniCredit SpA				
2,200 % éch. 22/07/2027		2 150	2 082	0,02
5,459 % éch. 30/06/2035	$	4 194	3 416	0,03
7,296 % éch. 02/04/2034		12 230	11 231	0,11
7,830 % éch. 04/12/2023		62 000	62 656	0,59
			265 801	2,52
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement italien				
6,875 % éch. 27/09/2023		10 700	10 777	0,10
Total Italie			276 578	2,62
JAPON				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
0,953 % éch. 19/07/2025		14 400	13 388	0,13
1,538 % éch. 20/07/2027		9 500	8 248	0,08
2,048 % éch. 17/07/2030		15 400	12 182	0,12
3,195 % éch. 18/07/2029		5 600	4 901	0,05
3,273 % éch. 19/09/2025	€	3 100	3 259	0,03
Mizuho Financial Group, Inc.				
1,979 % éch. 08/09/2031	$	7 100	5 445	0,05
2,201 % éch. 10/07/2031		9 100	7 123	0,07
Nissan Motor Co. Ltd.				
1,940 % éch. 15/09/2023	€	16 640	17 524	0,17
2,652 % éch. 17/03/2026		3 600	3 571	0,03
3,201 % éch. 17/09/2028		4 700	4 409	0,04
4,345 % éch. 17/09/2027	$	16 820	15 278	0,14
4,810 % éch. 17/09/2030		6 550	5 573	0,05
Nomura Holdings, Inc.				
1,851 % éch. 16/07/2025		25 950	23 676	0,22
2,172 % éch. 14/07/2028		5 000	4 137	0,04
2,679 % éch. 16/07/2030		1 800	1 443	0,01
2,710 % éch. 22/01/2029		9 800	8 184	0,08
3,103 % éch. 16/01/2030		4 500	3 763	0,04
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
2,440 % éch. 18/06/2024		11 500	11 058	0,10
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
2,130 % éch. 08/07/2030		3 500	2 774	0,03
2,696 % éch. 16/07/2024		4 700	4 510	0,04
2,750 % éch. 15/01/2030		2 600	2 187	0,02
3,102 % éch. 17/01/2023		4 200	4 197	0,04
Suntory Holdings Ltd.				
2,250 % éch. 16/10/2024		900	844	0,01
Total Japon			167 674	1,59

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AA Bond Co. Ltd.				
4,875 % éch. 31/07/2043	£	400	$ 456	0,00
5,500 % éch. 31/07/2050		7 782	8 121	0,08
G City Europe Ltd.				
4,250 % éch. 11/09/2025	€	24 900	22 320	0,21
Heathrow Funding Ltd.				
1,875 % éch. 12/07/2032		2 800	2 333	0,02
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP				
5,844 % éch. 05/11/2031 (f)	£	18 367	22 611	0,22
Total Jersey, Îles Anglo-normandes			55 841	0,53
LUXEMBOURG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Altice Financing S.A.				
4,250 % éch. 15/08/2029	€	1 300	1 126	0,01
Aroundtown S.A.				
0,000 % éch. 16/07/2026 (d)		14 300	10 891	0,10
0,375 % éch. 15/04/2027		2 400	1 699	0,02
3,000 % éch. 16/10/2029	£	1 300	987	0,01
5,375 % éch. 21/03/2029	$	48 200	36 539	0,35
Becton Dickinson Euro Finance SARL				
0,334 % éch. 13/08/2028	€	4 500	3 968	0,04
1,336 % éch. 13/08/2041		5 180	3 444	0,03
Bevco Lux SARL				
1,000 % éch. 16/01/2030		3 700	2 976	0,03
1,500 % éch. 16/09/2027		23 000	21 348	0,20
CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.				
0,750 % éch. 17/04/2026		3 600	3 454	0,03
1,125 % éch. 17/10/2028		8 000	7 109	0,07
CPI Property Group S.A.				
1,500 % éch. 27/01/2031		10 500	6 504	0,06
1,625 % éch. 23/04/2027		34 550	26 342	0,25
1,750 % éch. 14/01/2030		10 900	7 098	0,07
2,750 % éch. 12/05/2026		15 300	12 860	0,12
2,750 % éch. 22/01/2028	£	2 100	1 692	0,02
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % éch. 19/11/2025	€	19 575	16 892	0,16
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.				
2,949 % éch. 24/01/2024		500	403	0,00
3,125 % éch. 17/11/2023		1 800	1 374	0,01
Helvetia Europe S.A.				
2,750 % éch. 30/09/2041		4 700	3 899	0,04
Lincoln Financing SARL				
3,625 % éch. 01/04/2024		3 300	3 488	0,03
Logicor Financing SARL				
1,500 % éch. 13/07/2026		5 700	5 152	0,05
1,625 % éch. 15/07/2027		41 500	36 064	0,34
2,750 % éch. 15/01/2030	£	1 530	1 404	0,01
3,250 % éch. 13/11/2028	€	2 409	2 169	0,02
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
5,125 % éch. 29/10/2022 ^	$	61 150	7 147	0,07
5,250 % éch. 23/05/2023 ^ (h)		12 200	1 642	0,02
			227 671	2,16
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Delos Finance SARL				
6,480 % éch. 06/10/2023		18 243	18 239	0,17
Total Luxembourg			245 910	2,33
ÎLE MAURICE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Greenko Investment Co.				
4,875 % éch. 16/08/2023		5 600	5 495	0,05
Greenko Power Ltd.				
4,300 % éch. 13/12/2028		3 629	3 048	0,03
Greenko Solar Mauritius Ltd.				
5,550 % éch. 29/01/2025		15 400	14 534	0,14
5,950 % éch. 29/07/2026		6 900	6 322	0,06
India Green Energy Holdings				
5,375 % éch. 29/04/2024		9 900	9 531	0,09
Total Île Maurice			38 930	0,37

DESCRIPTION		ACTIONS / VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
MEXIQUE				
ACTIONS ORDINAIRES				
Desarrolladora Homex S.A.B. de C.V. (c)		427 064	$ 1	0,00
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Inbursa S.A.				
4,375 % éch. 11/04/2027	$	4 993	4 714	0,04
Banco Mercantil del Norte S.A.				
5,875 % éch. 24/01/2027 (f)(h)		4 400	3 932	0,04
6,625 % éch. 24/01/2032 (f)(h)		9 600	7 966	0,08
Petroleos Mexicanos				
2,750 % éch. 21/04/2027	€	200	168	0,00
3,750 % éch. 21/02/2024		100	105	0,00
4,875 % éch. 21/02/2028		500	437	0,00
Trust Fibra Uno				
4,869 % éch. 15/01/2030	$	1 900	1 635	0,02
			18 957	0,18
Total Mexique			18 958	0,18
MULTINATIONALES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Delta Air Lines, Inc.				
4,750 % éch. 20/10/2028		3 600	3 389	0,03
PAYS-BAS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
ABN AMRO Bank NV				
4,375 % éch. 22/09/2025 (f)(h)	€	9 700	9 572	0,09
AerCap Holdings NV				
5,875 % éch. 10/10/2079	$	4 000	3 648	0,04
ASR Nederland NV				
3,375 % éch. 02/05/2049	€	4 300	3 936	0,04
7,000 % éch. 07/12/2043		2 700	2 893	0,03
Cooperatieve Rabobank UA				
4,375 % éch. 29/06/2027 (f)(h)		19 200	18 291	0,17
4,655 % éch. 22/08/2028	$	6 800	6 538	0,06
CTP NV				
0,500 % éch. 21/06/2025	€	9 400	8 422	0,08
1,250 % éch. 21/06/2029		12 800	9 107	0,09
Digital Dutch Finco BV				
1,000 % éch. 15/01/2032		2 600	1 951	0,02
1,250 % éch. 01/02/2031		12 400	9 721	0,09
Enel Finance International NV				
1,875 % éch. 12/07/2028	$	600	478	0,01
IMCD NV				
2,500 % éch. 26/03/2025	€	4 700	4 873	0,05
ING Groep NV				
0,375 % éch. 29/09/2028		4 300	3 797	0,04
4,875 % éch. 16/05/2029 (f)(h)	$	21 300	16 507	0,16
5,750 % éch. 16/11/2026 (f)(h)		10 000	8 882	0,08
JAB Holdings BV				
1,000 % éch. 20/12/2027	€	5 000	4 601	0,04
2,200 % éch. 23/11/2030	$	20 150	15 155	0,14
2,250 % éch. 19/12/2039	€	4 800	3 498	0,03
LeasePlan Corp. NV				
0,125 % éch. 13/09/2023		6 340	6 602	0,06
2,875 % éch. 24/10/2024	$	1 020	958	0,01
7,375 % éch. 29/05/2024 (f)(h)	€	1 000	1 060	0,01
NE Property BV				
1,875 % éch. 09/10/2026		3 500	3 148	0,03
2,000 % éch. 20/01/2030		7 000	5 187	0,05
3,375 % éch. 14/07/2027		11 700	10 836	0,10
NN Group NV				
4,625 % éch. 13/01/2048		2 000	2 059	0,02
Prosus NV				
1,539 % éch. 03/08/2028		3 700	3 208	0,03
2,031 % éch. 03/08/2032		25 780	19 570	0,19
4,027 % éch. 03/08/2050	$	3 800	2 384	0,02
4,193 % éch. 19/01/2032		3 800	3 155	0,03
Sagax Euro MTN NL BV				
0,750 % éch. 26/01/2028	€	6 100	4 905	0,05
1,625 % éch. 24/02/2026		5 900	5 544	0,05

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Syngenta Finance NV				
3,375 % éch. 16/04/2026	€	18 100	$ 18 263	0,17
4,441 % éch. 24/04/2023	$	3 100	3 087	0,03
4,892 % éch. 24/04/2025		6 784	6 576	0,06
Volkswagen Financial Services NV				
0,875 % éch. 20/02/2025	£	7 000	7 612	0,07
1,125 % éch. 18/09/2023		13 700	16 080	0,15
1,875 % éch. 03/12/2024		1 800	2 023	0,02
Vonovia Finance BV				
0,500 % éch. 14/09/2029	€	500	393	0,00
1,125 % éch. 14/09/2034		1 000	676	0,01
WPC Eurobond BV				
1,350 % éch. 15/04/2028		5 400	4 803	0,05
			259 999	2,47
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
EMF-NL Prime BV				
2,178 % éch. 17/04/2041		479	490	0,01
Eurosail BV				
2,878 % éch. 17/10/2040		197	209	0,00
			699	0,01
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
BNG Bank NV				
2,375 % éch. 16/03/2026	$	9 300	8 735	0,08
Total Pays-Bas			269 433	2,56
NORVÈGE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Yara International ASA				
4,750 % éch. 01/06/2028		15 300	14 097	0,13
PANAMA				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Intercorp Financial Services, Inc.				
4,125 % éch. 19/10/2027		5 600	4 952	0,05
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Carnival Corp.				
5,648 % éch. 30/06/2025	€	13 966	14 367	0,13
Total Panama			19 319	0,18
PÉROU				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % éch. 17/09/2024	PEN	9 800	2 400	0,02
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement péruvien				
5,350 % éch. 12/08/2040		1 800	353	0,00
5,400 % éch. 12/08/2034		3 000	632	0,01
5,940 % éch. 12/02/2029		53 150	12 795	0,12
6,350 % éch. 12/08/2028		121 787	30 388	0,29
8,200 % éch. 12/08/2026		311 700	85 604	0,81
			129 772	1,23
Total Pérou			132 172	1,25
QATAR				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement qatari				
4,400 % éch. 16/04/2050	$	11 300	10 371	0,10
ROUMANIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement roumain				
1,375 % éch. 02/12/2029	€	3 425	2 669	0,02
1,750 % éch. 13/07/2030		7 650	5 705	0,05
2,125 % éch. 07/03/2028		7 200	6 432	0,06
2,625 % éch. 02/12/2040		22 600	13 514	0,13
2,875 % éch. 13/04/2042		8 200	4 922	0,05
Total Roumanie			33 242	0,31

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
RUSSIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
MMK International Capital DAC				
4,375 % éch. 13/06/2024 ^	$	4 900	$ 1 715	0,02
ARABIE SAOUDITE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite				
2,250 % éch. 02/02/2033		20 200	16 448	0,16
SINGAPOUR				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd.				
1,832 % éch. 10/09/2030 (h)		13 500	12 127	0,12
SP PowerAssets Ltd.				
3,000 % éch. 26/09/2027		2 400	2 228	0,02
United Overseas Bank Ltd.				
1,750 % éch. 16/03/2031 (h)		3 500	3 095	0,03
Total Singapour			17 450	0,17
SLOVAQUIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement slovaque				
1,875 % éch. 09/03/2037	€	500	418	0,00
SLOVÉNIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % éch. 27/01/2025		10 700	10 359	0,10
AFRIQUE DU SUD				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AngloGold Ashanti Holdings PLC				
3,375 % éch. 01/11/2028	$	5 500	4 805	0,05
3,750 % éch. 01/10/2030		7 800	6 772	0,06
Growthpoint Properties International Pty. Ltd.				
5,872 % éch. 02/05/2023		3 050	3 039	0,03
			14 616	0,14
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement sud-africain				
10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	1 385 10 0	86 060	0,81
Total Afrique du Sud			100 676	0,95
CORÉE DU SUD				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Shinhan Bank Co. Ltd.				
1,183 % éch. 29/09/2025	AUD	7 200	4 367	0,04
Shinhan Financial Group Co. Ltd.				
3,340 % éch. 05/02/2030 (h)	$	3 000	2 750	0,03
Total Corée du Sud			7 117	0,07
ESPAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Abertis Infraestructuras S.A.				
2,250 % éch. 29/03/2029	€	4 700	4 338	0,04
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
5,875 % éch. 24/09/2023 (f)(h)		3 200	3 291	0,03
Banco de Sabadell S.A.				
1,125 % éch. 11/03/2027		3 600	3 441	0,03
Banco Santander S.A.				
1,500 % éch. 14/04/2026	£	4 300	4 518	0,04
Bankinter S.A.				
0,875 % éch. 08/07/2026	€	7 600	7 206	0,07
CaixaBank S.A.				
3,625 % éch. 14/09/2028 (f)(h)		5 400	4 071	0,04
Total Espagne			26 865	0,25

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
SUPRANATIONALES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banque européenne pour la reconstruction et le développement				
1,500 % éch. 13/02/2025	$	5 200	$ 4 889	0,05
1,625 % éch. 27/09/2024		500	475	0,00
Banque européenne d'investissement				
0,750 % éch. 15/11/2024	£	15 350	17 344	0,17
Total Supranationales			22 708	0,22
SUÈDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Castellum AB				
2,125 % éch. 20/11/2023	€	4 300	4 409	0,04
Fastighets AB Balder				
1,125 % éch. 29/01/2027 (j)		4 500	3 576	0,03
Sagax AB				
1,125 % éch. 30/01/2027		4 200	3 630	0,04
2,250 % éch. 13/03/2025		8 400	8 284	0,08
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB				
1,000 % éch. 12/08/2027		18 600	13 882	0,13
Total Suède			33 781	0,32
SUISSE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Credit Suisse AG				
6,500 % éch. 08/08/2023 (h)	$	95 950	93 139	0,88
Credit Suisse Group AG				
2,125 % éch. 15/11/2029	£	1 700	1 456	0,01
2,593 % éch. 11/09/2025	$	18 030	15 950	0,15
4,194 % éch. 01/04/2031		5 200	4 047	0,04
4,207 % éch. 12/06/2024		31 150	30 376	0,29
6,250 % éch. 18/12/2024 (f)(h)		200	158	0,00
6,375 % éch. 21/08/2026 (f)(h)		7 000	5 034	0,05
7,500 % éch. 17/07/2023 (f)(h)		14 600	11 704	0,11
7,500 % éch. 11/12/2023 (f)(h)		200	175	0,00
UBS AG				
5,125 % éch. 15/05/2024 (h)		8 900	8 803	0,08
UBS Group AG				
1,494 % éch. 10/08/2027		5 000	4 308	0,04
2,746 % éch. 11/02/2033		3 300	2 559	0,03
3,126 % éch. 13/08/2030		400	340	0,00
4,125 % éch. 24/09/2025		58 990	57 418	0,55
Total Suisse			235 467	2,23
THAÏLANDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Bangkok Bank PCL				
3,466 % éch. 23/09/2036 (h)		9 200	7 211	0,07
TURQUIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Turkish Airlines Pass-Through Trust				
4,200 % éch. 15/09/2028		4 544	3 980	0,04
UKRAINE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement ukrainien				
7,750 % éch. 01/09/2024 ^		7 600	1 911	0,02
ÉMIRATS ARABES UNIS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
DAE Sukuk Difc Ltd.				
3,750 % éch. 15/02/2026		8 600	8 180	0,08
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Barclays PLC				
2,645 % éch. 24/06/2031		8 000	6 259	0,06
4,375 % éch. 12/01/2026		9 860	9 553	0,09
5,501 % éch. 09/08/2028		8 150	7 907	0,08
7,125 % éch. 15/06/2025 (f)(h)	£	9 600	10 946	0,10
7,250 % éch. 15/03/2023 (f)(h)		22 350	26 642	0,25
7,750 % éch. 15/09/2023 (f)(h)	$	700	685	0,01
8,000 % éch. 15/06/2024 (f)(h)		4 300	4 189	0,04

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
BAT International Finance PLC				
1,668 % éch. 25/03/2026	$	5 990	$ 5 314	0,05
Broadgate Financing PLC				
4,851 % éch. 05/04/2033	£	49	59	0,00
Cadent Finance PLC				
2,625 % éch. 22/09/2038		300	245	0,00
2,750 % éch. 22/09/2046		3 200	2 373	0,02
Chanel Ceres PLC				
0,500 % éch. 31/07/2026	€	11 800	11 351	0,11
1,000 % éch. 31/07/2031		6 800	5 606	0,05
Connect Plus M25 Issuer PLC				
2,607 % éch. 31/03/2039	£	2 054	2 010	0,02
Direct Line Insurance Group PLC				
4,000 % éch. 05/06/2032		1 200	1 134	0,01
DWR Cymru Financing UK PLC				
3,514 % éch. 31/03/2030		30	42	0,00
Ferguson Finance PLC				
3,250 % éch. 02/06/2030	$	4 300	3 656	0,04
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC				
1,500 % éch. 17/02/2027	€	19 400	14 086	0,13
3,250 % éch. 25/02/2030	$	8 000	5 703	0,05
Greene King Finance PLC				
4,064 % éch. 15/03/2035	£	4 632	4 721	0,05
5,106 % éch. 15/03/2034		92	98	0,00
5,318 % éch. 15/09/2031		229	256	0,00
5,602 % éch. 15/03/2036		900	823	0,01
HSBC Holdings PLC				
1,750 % éch. 24/07/2027		21 760	22 534	0,21
2,357 % éch. 18/08/2031	$	6 600	5 057	0,05
2,848 % éch. 04/06/2031		8 500	6 802	0,06
3,973 % éch. 22/05/2030		11 300	9 913	0,09
4,041 % éch. 13/03/2028		17 400	16 060	0,15
4,292 % éch. 12/09/2026		2 500	2 394	0,02
4,600 % éch. 17/12/2030 (f)(h)		11 900	9 288	0,09
6,000 % éch. 29/09/2023 (f)(h)	€	4 744	5 013	0,05
6,115 % éch. 12/09/2026	$	526	518	0,01
6,500 % éch. 23/03/2028 (f)(h)		14 335	13 230	0,13
Imperial Brands Finance PLC				
3,125 % éch. 26/07/2024		1 300	1 244	0,01
3,500 % éch. 26/07/2026		21 660	19 892	0,19
3,875 % éch. 26/07/2029		11 840	10 151	0,10
Informa PLC				
1,250 % éch. 22/04/2028	€	9 200	8 345	0,08
1,500 % éch. 05/07/2023		7 818	8 274	0,08
2,125 % éch. 06/10/2025		20 190	20 509	0,19
3,125 % éch. 05/07/2026	£	100	109	0,00
InterContinental Hotels Group PLC				
1,625 % éch. 08/10/2024	€	15 000	15 342	0,15
3,375 % éch. 08/10/2028	£	10 800	11 254	0,11
John Lewis PLC				
4,250 % éch. 18/12/2034		2 800	2 050	0,02
6,125 % éch. 21/01/2025		2 050	2 370	0,02
Lloyds Bank PLC				
0,000 % éch. 02/04/2032	$	25 600	15 665	0,15
Lloyds Banking Group PLC				
2,250 % éch. 16/10/2024	£	900	1 029	0,01
4,947 % éch. 27/06/2025 (f)(h)	€	5 200	5 328	0,05
5,125 % éch. 27/12/2024 (f)(h)	£	4 100	4 550	0,04
M&G PLC				
6,340 % éch. 19/12/2063		500	535	0,01
Market Bidco Finco PLC				
4,750 % éch. 04/11/2027	€	11 500	9 903	0,09
Marks & Spencer PLC				
3,750 % éch. 19/05/2026	£	6 900	7 255	0,07
6,000 % éch. 12/06/2025		6 409	7 438	0,07
Mitchells & Butlers Finance PLC				
3,972 % éch. 15/12/2030		629	683	0,01
6,013 % éch. 15/12/2030		432	486	0,00
National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC				
3,530 % éch. 20/09/2028	€	3 000	3 129	0,03
Nationwide Building Society				
3,766 % éch. 08/03/2024	$	400	398	0,00
5,875 % éch. 20/12/2024 (f)(h)	£	8 150	9 282	0,09
NatWest Group PLC				
0,750 % éch. 15/11/2025	€	800	799	0,01
4,269 % éch. 22/03/2025	$	8 800	8 610	0,08
4,800 % éch. 05/04/2026		8 800	8 616	0,08
4,892 % éch. 18/05/2029		8 625	8 176	0,08
5,076 % éch. 27/01/2030	$	8 560	$ 8 081	0,08
Pinnacle Bidco PLC				
5,500 % éch. 15/02/2025	€	800	751	0,01
Quadgas Finance PLC				
3,375 % éch. 17/09/2029	£	300	293	0,00
Rolls-Royce PLC				
1,625 % éch. 09/05/2028	€	300	255	0,00
5,750 % éch. 15/10/2027	£	800	886	0,01
Sage Group PLC				
1,625 % éch. 25/02/2031		1 500	1 350	0,01
Santander UK Group Holdings PLC				
2,896 % éch. 15/03/2032	$	500	388	0,00
2,920 % éch. 08/05/2026	£	2 700	3 001	0,03
3,530 % éch. 25/08/2028	€	2 000	1 999	0,02
3,625 % éch. 14/01/2026	£	5 600	6 276	0,06
4,750 % éch. 15/09/2025	$	18 557	17 699	0,17
6,750 % éch. 24/06/2024 (f)(h)	£	15 950	18 487	0,18
Santander UK PLC				
3,782 % éch. 12/02/2027		11 800	14 175	0,13
Scottish Power UK PLC				
6,750 % éch. 29/05/2023		500	607	0,01
Standard Chartered PLC				
1,456 % éch. 14/01/2027	$	16 100	13 980	0,13
2,819 % éch. 30/01/2026		2 300	2 141	0,02
3,265 % éch. 18/02/2036		5 700	4 226	0,04
3,603 % éch. 12/01/2033		5 900	4 452	0,04
4,644 % éch. 01/04/2031		9 100	8 198	0,08
Telereal Secured Finance PLC				
4,010 % éch. 10/12/2033	£	235	260	0,00
Tesco Property Finance PLC				
5,744 % éch. 13/04/2040		854	961	0,01
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % éch. 18/11/2028		5 900	5 231	0,05
5,250 % éch. 26/01/2024		9 086	10 681	0,10
5,250 % éch. 29/05/2026		16 900	18 820	0,18
Virgin Money UK PLC				
2,875 % éch. 24/06/2025	€	6 700	6 856	0,07
3,125 % éch. 22/06/2025	£	3 000	3 418	0,03
3,375 % éch. 24/04/2026		3 647	4 053	0,04
4,000 % éch. 25/09/2026		10 387	11 608	0,11
4,000 % éch. 03/09/2027		11 282	12 277	0,12
9,250 % éch. 08/06/2024 (f)(h)		5 514	6 643	0,06
Weir Group PLC				
2,200 % éch. 13/05/2026	$	8 500	7 548	0,07
			601 490	5,71
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Canary Wharf Finance PLC				
5,952 % éch. 22/10/2037	£	55	70	0,00
Great Hall Mortgages PLC				
4,868 % éch. 18/06/2039	$	738	723	0,01
Newgate Funding PLC				
3,839 % éch. 01/12/2050	£	130	147	0,00
			940	0,01
Total Royaume-Uni			602 430	5,72
ÉTATS-UNIS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
AASET Trust				
3,967 % éch. 16/05/2042	$	2 760	2 143	0,02
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
5,289 % éch. 25/12/2034		1 031	924	0,01
5,334 % éch. 25/05/2035		1 900	1 665	0,02
Aegis Asset-Backed Securities Trust				
4,559 % éch. 25/01/2037		3 848	2 931	0,03
Ameriquest Mortgage Securities Trust				
4,974 % éch. 25/03/2036		155	154	0,00
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,094 % éch. 25/01/2036		1 818	1 809	0,02
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
3,988 % éch. 25/08/2032		100	94	0,00
First Franklin Mortgage Loan Trust				
5,109 % éch. 25/10/2035		56	56	0,00
Fremont Home Loan Trust				
4,709 % éch. 25/08/2036		7 134	2 473	0,02
GSAMP Trust				
4,559 % éch. 25/01/2037	$	1 413	$ 1 353	0,01
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
4,579 % éch. 25/04/2037		4 912	3 248	0,03
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
4,599 % éch. 25/10/2036		1 278	1 256	0,01
L2L Education Loan Trust				
4,658 % éch. 15/06/2031		1 452	1 451	0,01
Labrador Aviation Finance Ltd.				
4,300 % éch. 15/01/2042		13 428	10 642	0,10
Long Beach Mortgage Loan Trust				
4,549 % éch. 25/12/2036		4 368	3 003	0,03
5,439 % éch. 25/06/2035		4 907	4 752	0,05
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
5,109 % éch. 25/12/2034		1 827	1 676	0,02
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,439 % éch. 25/04/2035		1 800	1 664	0,02
New Century Home Equity Loan Trust				
5,319 % éch. 25/11/2034		234	222	0,00
Option One Mortgage Loan Trust				
4,529 % éch. 25/01/2037		4 684	2 792	0,03
Residential Asset Mortgage Products Trust				
4,849 % éch. 25/12/2035		392	333	0,00
Residential Asset Securities Corp. Trust				
5,049 % éch. 25/11/2035		552	550	0,01
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
4,969 % éch. 25/12/2035		461	443	0,00
5,064 % éch. 25/01/2035		97	89	0,00
SLM Private Credit Student Loan Trust				
5,009 % éch. 16/12/2041		1 631	1 583	0,01
Soundview Home Loan Trust				
4,849 % éch. 25/06/2036		4 160	3 973	0,04
Structured Asset Investment Loan Trust				
5,009 % éch. 25/01/2036		3 797	3 406	0,03
			54 685	0,52

	ACTIONS		
ACTIONS ORDINAIRES			
SERVICES FINANCIERS			
Stearns Holdings LLC « B » (c)	1 508 783	0	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
7-Eleven, Inc.				
1,800 % éch. 10/02/2031	$	9 150	7 009	0,07
Adventist Health System				
5,430 % éch. 01/03/2032		2 000	1 976	0,02
AEP Texas, Inc.				
2,100 % éch. 01/07/2030		8 135	6 614	0,06
AES Corp.				
3,300 % éch. 15/07/2025		9 500	8 974	0,08
3,950 % éch. 15/07/2030		6 000	5 320	0,05
Alaska Airlines Pass-Through Trust				
4,800 % éch. 15/02/2029		8 221	7 840	0,07
Alexandria Real Estate Equities, Inc.				
4,300 % éch. 15/01/2026		12 150	11 850	0,11
Allegion U.S. Holding Co., Inc.				
3,550 % éch. 01/10/2027		9 800	8 861	0,08
Ally Financial, Inc.				
2,200 % éch. 02/11/2028		800	625	0,01
8,000 % éch. 01/11/2031		12 265	12 712	0,12
American Airlines Pass-Through Trust				
3,000 % éch. 15/04/2030		2 164	1 880	0,02
3,150 % éch. 15/08/2033		9 064	7 525	0,07
3,200 % éch. 15/12/2029		10 058	8 745	0,08
3,250 % éch. 15/04/2030		1 623	1 264	0,01
3,350 % éch. 15/04/2031		7 867	6 810	0,06
3,375 % éch. 01/11/2028		8 724	7 292	0,07
3,500 % éch. 15/08/2033		11 886	9 040	0,09
3,575 % éch. 15/07/2029		2 072	1 853	0,02
3,600 % éch. 22/03/2029		969	871	0,01
3,600 % éch. 15/04/2031		4 312	3 376	0,03
3,650 % éch. 15/08/2030		1 407	1 255	0,01
4,000 % éch. 15/01/2027		2 390	2 076	0,02
4,100 % éch. 15/07/2029		1 061	867	0,01

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
American Electric Power Co., Inc.			
3,875 % éch. 15/02/2062	$ 6 200	$ 4 838	0,05
4,300 % éch. 01/12/2028	4 600	4 402	0,04
American Homes 4 Rent LP			
4,250 % éch. 15/02/2028	500	463	0,00
4,900 % éch. 15/02/2029	9 200	8 714	0,08
American Tower Corp.			
0,500 % éch. 15/01/2028	€ 17 900	15 719	0,15
1,000 % éch. 15/01/2032	14 300	11 241	0,11
1,375 % éch. 04/04/2025	800	805	0,01
1,450 % éch. 15/09/2026	$ 5 900	5 156	0,05
1,875 % éch. 15/10/2030	4 800	3 715	0,04
1,950 % éch. 22/05/2026	€ 8 800	8 707	0,08
2,100 % éch. 15/06/2030	$ 6 500	5 159	0,05
2,300 % éch. 15/09/2031	3 900	3 041	0,03
2,400 % éch. 15/03/2025	3 800	3 578	0,03
2,950 % éch. 15/01/2025	29 670	28 321	0,27
3,125 % éch. 15/01/2027	5 900	5 415	0,05
3,800 % éch. 15/08/2029	9 134	8 306	0,08
3,950 % éch. 15/03/2029	600	554	0,01
American Transmission Systems, Inc.			
5,000 % éch. 01/09/2044	1 539	1 406	0,01
Anheuser-Busch Cos. LLC			
4,900 % éch. 01/02/2046	8 800	8 044	0,08
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.			
4,600 % éch. 15/04/2048	6 098	5 330	0,05
5,450 % éch. 23/01/2039	7 000	7 016	0,07
Antares Holdings LP			
2,750 % éch. 15/01/2027	5 800	4 653	0,04
3,950 % éch. 15/07/2026	3 500	3 031	0,03
Ares Capital Corp.			
2,875 % éch. 15/06/2027	8 500	7 216	0,07
Ares Finance Co. LLC			
3,250 % éch. 15/06/2030	15 600	12 907	0,12
Ashtead Capital, Inc.			
1,500 % éch. 12/08/2026	1 400	1 196	0,01
4,000 % éch. 01/05/2028	7 041	6 432	0,06
AT&T, Inc.			
3,550 % éch. 15/09/2055	19 608	13 171	0,12
3,650 % éch. 15/09/2059	15 243	10 273	0,10
Aviation Capital Group LLC			
3,500 % éch. 01/11/2027	8 302	7 264	0,07
3,875 % éch. 01/05/2023	2 043	2 027	0,02
4,375 % éch. 30/01/2024	13 999	13 654	0,13
5,500 % éch. 15/12/2024	2 600	2 556	0,02
Bank of America Corp.			
0,580 % éch. 08/08/2029	€ 12 000	10 411	0,10
1,898 % éch. 23/07/2031	$ 4 200	3 233	0,03
1,949 % éch. 27/10/2026	€ 3 000	3 008	0,03
2,551 % éch. 04/02/2028	$ 26 100	23 218	0,22
2,592 % éch. 29/04/2031	15 000	12 249	0,12
2,651 % éch. 11/03/2032	10 000	8 028	0,08
2,687 % éch. 22/04/2032	3 400	2 729	0,03
4,271 % éch. 23/07/2029	2 300	2 149	0,02
4,300 % éch. 28/01/2025 (f)	27 900	24 298	0,23
5,015 % éch. 22/07/2033	5 000	4 762	0,05
5,285 % éch. 23/07/2024	35 600	35 610	0,34
Bank of America N.A.			
6,000 % éch. 15/10/2036	7 150	7 333	0,07
BAT Capital Corp.			
2,726 % éch. 25/03/2031	6 500	5 086	0,05
Bayer U.S. Finance LLC			
4,250 % éch. 15/12/2025	400	388	0,00
4,375 % éch. 15/12/2028	22 680	21 336	0,20
5,779 % éch. 15/12/2023	6 900	6 886	0,07
Becton Dickinson and Co.			
0,034 % éch. 13/08/2025	€ 2 300	2 233	0,02
Berry Global, Inc.			
1,000 % éch. 15/01/2025	9 900	9 962	0,09
1,500 % éch. 15/01/2027	9 100	8 693	0,08
4,875 % éch. 15/07/2026	$ 3 100	2 992	0,03
Blackstone Private Credit Fund			
2,350 % éch. 22/11/2024	13 100	11 999	0,11
BlueScope Finance Americas LLC			
4,625 % éch. 25/05/2023	26 530	26 381	0,25
Boeing Co.			
2,196 % éch. 04/02/2026	33 500	30 474	0,29
3,250 % éch. 01/02/2028	4 400	4 003	0,04
5,150 % éch. 01/05/2030	1 706	1 669	0,02

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Boston Scientific Corp.			
0,625 % éch. 01/12/2027	€ 3 060	$ 2 815	0,03
2,650 % éch. 01/06/2030	$ 15 900	13 619	0,13
British Airways Pass-Through Trust			
3,300 % éch. 15/06/2034	12 179	10 365	0,10
3,350 % éch. 15/12/2030	855	740	0,01
3,800 % éch. 20/03/2033	72	65	0,00
4,125 % éch. 20/03/2033	72	60	0,00
4,250 % éch. 15/05/2034	698	627	0,01
4,625 % éch. 20/12/2025	706	686	0,01
Broadcom, Inc.			
2,450 % éch. 15/02/2031	12 900	10 190	0,10
2,600 % éch. 15/02/2033	3 300	2 486	0,02
3,187 % éch. 15/11/2036	34 991	25 243	0,24
3,469 % éch. 15/04/2034	18 649	14 932	0,14
3,500 % éch. 15/02/2041	200	143	0,00
4,926 % éch. 15/05/2037	17 568	15 389	0,15
Brooklyn Union Gas Co.			
3,865 % éch. 04/03/2029	500	450	0,00
Cameron LNG LLC			
3,402 % éch. 15/01/2038	4 300	3 507	0,03
3,701 % éch. 15/01/2039	8 325	6 628	0,06
Cantor Fitzgerald LP			
4,500 % éch. 14/04/2027	100	93	0,00
4,875 % éch. 01/05/2024	3 500	3 436	0,03
Carlyle Holdings Finance LLC			
5,625 % éch. 30/03/2043	100	89	0,00
CDW LLC			
3,569 % éch. 01/12/2031	6 500	5 368	0,05
Centene Corp.			
2,450 % éch. 15/07/2028	20 800	17 596	0,17
3,000 % éch. 15/10/2030	16 000	13 152	0,12
Charter Communications Operating LLC			
2,250 % éch. 15/01/2029	17 920	14 456	0,14
2,300 % éch. 01/02/2032	11 000	8 129	0,08
3,500 % éch. 01/06/2041	9 200	6 025	0,06
3,700 % éch. 01/04/2051	6 800	4 159	0,04
3,900 % éch. 01/06/2052	1 700	1 074	0,01
4,400 % éch. 01/12/2061	750	483	0,00
4,800 % éch. 01/03/2050	8 400	6 131	0,06
5,125 % éch. 01/07/2049	12 300	9 350	0,09
5,375 % éch. 01/04/2038	6 300	5 266	0,05
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC			
3,700 % éch. 15/11/2029	9 000	8 155	0,08
5,125 % éch. 30/06/2027	13 132	12 995	0,12
Cheniere Energy Partners LP			
3,250 % éch. 31/01/2032	6 600	5 254	0,05
4,000 % éch. 01/03/2031	11 900	10 147	0,10
Choice Hotels International, Inc.			
3,700 % éch. 01/12/2029	700	611	0,01
Citigroup, Inc.			
2,572 % éch. 03/06/2031 (i)	24 700	20 032	0,19
Cleveland Electric Illuminating Co.			
3,500 % éch. 01/04/2028	2 965	2 707	0,03
Constellation Energy Generation LLC			
5,750 % éch. 01/10/2041	2 500	2 439	0,02
Continental Resources, Inc.			
2,875 % éch. 01/04/2032	15 595	11 574	0,11
5,750 % éch. 15/01/2031	300	280	0,00
Corporate Office Properties LP			
2,250 % éch. 15/03/2026	5 200	4 565	0,04
CoStar Group, Inc.			
2,800 % éch. 15/07/2030	5 200	4 258	0,04
Crown Castle Towers LLC			
4,241 % éch. 15/07/2048	5 800	5 282	0,05
Crown Castle, Inc.			
2,250 % éch. 15/01/2031	12 500	10 058	0,10
3,100 % éch. 15/11/2029	12 805	11 190	0,11
3,250 % éch. 15/01/2051	5 400	3 534	0,03
3,800 % éch. 15/02/2028	3 765	3 506	0,03
4,300 % éch. 15/02/2029	4 000	3 786	0,04
4,450 % éch. 15/02/2026	20 933	20 481	0,19
CVS Pass-Through Trust			
4,704 % éch. 10/01/2036	214	192	0,00
5,926 % éch. 10/01/2034	1 991	1 945	0,02
6,036 % éch. 10/12/2028	1 181	1 164	0,01
7,507 % éch. 10/01/2032	1 308	1 362	0,01
8,353 % éch. 10/07/2031	240	262	0,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
DAE Funding LLC			
1,550 % éch. 01/08/2024	$ 19 866	$ 18 474	0,18
1,625 % éch. 15/02/2024	19 500	18 520	0,18
3,375 % éch. 20/03/2028	24 600	21 872	0,21
Daimler Trucks Finance North America LLC			
1,625 % éch. 13/12/2024	2 900	2 693	0,03
2,000 % éch. 14/12/2026	7 510	6 627	0,06
Dell International LLC			
4,900 % éch. 01/10/2026	11 904	11 734	0,11
5,300 % éch. 01/10/2029	4 500	4 411	0,04
6,020 % éch. 15/06/2026	23 099	23 593	0,22
Delta Air Lines, Inc.			
2,900 % éch. 28/10/2024	14 442	13 706	0,13
3,750 % éch. 28/10/2029	18 900	15 744	0,15
7,375 % éch. 15/01/2026	1 730	1 770	0,02
Digital Realty Trust LP			
5,550 % éch. 15/01/2028	5 000	5 042	0,05
Discovery Communications LLC			
2,500 % éch. 20/09/2024	£ 2 400	2 743	0,03
DISH DBS Corp.			
5,250 % éch. 01/12/2026	$ 3 100	2 617	0,02
5,750 % éch. 01/12/2028	3 100	2 480	0,02
DTE Electric Co.			
1,900 % éch. 01/04/2028	4 700	4 093	0,04
Duke Energy Carolinas LLC			
4,000 % éch. 30/09/2042	122	101	0,00
Duke Energy Corp.			
4,300 % éch. 15/03/2028	3 613	3 483	0,03
Enel Finance America LLC			
7,100 % éch. 14/10/2027	2 800	2 900	0,03
Energy Transfer LP			
4,400 % éch. 15/03/2027	6 745	6 417	0,06
5,150 % éch. 01/02/2043	2 294	1 907	0,02
5,150 % éch. 15/03/2045	7 503	6 242	0,06
5,300 % éch. 01/04/2044	4 130	3 504	0,03
5,300 % éch. 15/04/2047	675	565	0,01
5,350 % éch. 15/05/2045	7 181	6 121	0,06
7,500 % éch. 01/07/2038	5 734	6 115	0,06
7,600 % éch. 01/02/2024	10 400	10 577	0,10
Entergy Louisiana LLC			
3,780 % éch. 01/04/2025	25 100	24 131	0,23
Enterprise Products Operating LLC			
5,250 % éch. 16/08/2077	4 739	3 818	0,04
5,375 % éch. 15/02/2078	5 614	4 289	0,04
7,630 % éch. 16/08/2077	5 988	5 428	0,05
EPR Properties			
4,500 % éch. 01/04/2025	4 420	4 196	0,04
4,500 % éch. 01/06/2027	6 440	5 646	0,05
4,750 % éch. 15/12/2026	4 425	3 982	0,04
4,950 % éch. 15/04/2028	1 986	1 698	0,02
EQT Corp.			
7,000 % éch. 01/02/2030	500	519	0,00
Essex Portfolio LP			
3,625 % éch. 01/05/2027	4 000	3 744	0,04
Evergy Missouri West, Inc.			
5,150 % éch. 15/12/2027	2 000	1 996	0,02
Exelon Corp.			
4,050 % éch. 15/04/2030	3 540	3 295	0,03
Expedia Group, Inc.			
2,950 % éch. 15/03/2031	1 766	1 424	0,01
3,250 % éch. 15/02/2030	7 000	5 953	0,06
3,800 % éch. 15/02/2028	10 805	9 938	0,09
6,250 % éch. 01/05/2025	983	992	0,01
Fells Point Funding Trust			
3,046 % éch. 31/01/2027	6 150	5 606	0,05
FirstEnergy Transmission LLC			
4,550 % éch. 01/04/2049	2 083	1 695	0,02
Fiserv, Inc.			
3,000 % éch. 01/07/2031	£ 800	803	0,01
Flex Intermediate Holdco LLC			
3,363 % éch. 30/06/2031	$ 34 000	26 618	0,25
Ford Foundation			
2,815 % éch. 01/06/2070	1 600	941	0,01
Ford Motor Credit Co. LLC			
2,330 % éch. 25/11/2025	€ 5 450	5 368	0,05
2,492 % éch. 15/11/2023	1 033	1 086	0,01
2,684 % éch. 01/12/2024	3 187	3 289	0,03

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
3,021 % éch. 06/03/2024	€	13 290	$ 13 936	0,13
3,250 % éch. 15/09/2025		1 400	1 423	0,01
4,535 % éch. 06/03/2025	£	2 900	3 324	0,03
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC				
6,500 % éch. 01/10/2025	$	8 503	8 009	0,08
Freedom Mortgage Corp.				
8,125 % éch. 15/11/2024		6 741	6 212	0,06
8,250 % éch. 15/04/2025		5 571	5 020	0,05
Freeport Minerals Corp.				
9,500 % éch. 01/06/2031		300	359	0,00
FS KKR Capital Corp.				
1,650 % éch. 12/10/2024		12 300	11 110	0,11
2,625 % éch. 15/01/2027		5 400	4 515	0,04
Georgia Power Co.				
3,250 % éch. 15/03/2051		200	139	0,00
Global Payments, Inc.				
5,950 % éch. 15/08/2052		2 200	2 000	0,02
GLP Capital LP				
3,350 % éch. 01/09/2024		4 000	3 840	0,04
4,000 % éch. 15/01/2031		4 000	3 438	0,03
5,300 % éch. 15/01/2029		15 224	14 434	0,14
5,375 % éch. 15/04/2026		5 600	5 503	0,05
5,750 % éch. 01/06/2028		14 330	14 115	0,13
Goldman Sachs Group, Inc.				
2,383 % éch. 21/07/2032		4 100	3 191	0,03
2,600 % éch. 07/02/2030		5 000	4 184	0,04
3,125 % éch. 25/07/2029	£	5 100	5 302	0,05
4,223 % éch. 01/05/2029	$	19 400	18 109	0,17
4,482 % éch. 23/08/2028		17 300	16 609	0,16
5,776 % éch. 15/05/2026		14 800	14 707	0,14
7,250 % éch. 10/04/2028	£	4 317	5 583	0,05
Goodman U.S. Finance Four LLC				
4,500 % éch. 15/10/2037	$	7 182	6 041	0,06
Goodman U.S. Finance Three LLC				
3,700 % éch. 15/03/2028		12 875	11 640	0,11
GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC				
3,625 % éch. 24/03/2032		500	440	0,00
Guardian Life Global Funding				
1,100 % éch. 23/06/2025		3 000	2 720	0,03
Gulfstream Natural Gas System LLC				
4,600 % éch. 15/09/2025		4 560	4 416	0,04
Hanover Insurance Group, Inc.				
4,500 % éch. 15/04/2026		740	725	0,01
HCA, Inc.				
3,500 % éch. 15/07/2051		3 800	2 453	0,02
4,125 % éch. 15/06/2029		3 100	2 837	0,03
4,500 % éch. 15/02/2027		3 800	3 668	0,03
Highwoods Realty LP				
2,600 % éch. 01/02/2031		6 800	5 098	0,05
4,200 % éch. 15/04/2029		2 500	2 184	0,02
Host Hotels & Resorts LP				
3,375 % éch. 15/12/2029		4 700	3 939	0,04
3,500 % éch. 15/09/2030		2 600	2 152	0,02
3,875 % éch. 01/04/2024		8 200	7 985	0,08
4,000 % éch. 15/06/2025		1 625	1 563	0,01
Hudson Pacific Properties LP				
3,250 % éch. 15/01/2030		2 325	1 767	0,02
Hyundai Capital America				
0,875 % éch. 14/06/2024		12 010	11 208	0,11
1,500 % éch. 15/06/2026		10 200	8 849	0,08
Infor, Inc.				
1,450 % éch. 15/07/2023		7 100	6 935	0,07
1,750 % éch. 15/07/2025		4 700	4 251	0,04
Integris Baptist Medical Center, Inc.				
3,875 % éch. 15/08/2050		8 300	6 036	0,06
Intercontinental Exchange, Inc.				
3,000 % éch. 15/09/2060		9 450	5 963	0,06
International Flavors & Fragrances, Inc.				
1,832 % éch. 15/10/2027		11 100	9 333	0,09
Ipalco Enterprises, Inc.				
3,700 % éch. 01/09/2024		2 858	2 771	0,03
4,250 % éch. 01/05/2030		200	178	0,00
Jackson National Life Global Funding				
2,650 % éch. 21/06/2024		600	573	0,01
Jersey Central Power & Light Co.				
4,300 % éch. 15/01/2026		880	851	0,01
4,700 % éch. 01/04/2024		3 800	3 749	0,04
JetBlue Pass-Through Trust				
4,000 % éch. 15/05/2034	$	956	$ 853	0,01
JPMorgan Chase & Co.				
2,069 % éch. 01/06/2029		6 600	5 524	0,05
2,301 % éch. 15/10/2025		32 500	30 648	0,29
2,545 % éch. 08/11/2032		10 000	7 930	0,08
2,580 % éch. 22/04/2032		16 700	13 418	0,13
2,739 % éch. 15/10/2030		35 800	30 098	0,29
3,702 % éch. 06/05/2030		9 300	8 360	0,08
3,782 % éch. 01/02/2028		3 569	3 340	0,03
3,797 % éch. 23/07/2024		7 500	7 427	0,07
4,565 % éch. 14/06/2030		10 000	9 430	0,09
5,215 % éch. 23/07/2024		14 100	14 123	0,13
Kilroy Realty LP				
2,500 % éch. 15/11/2032		1 100	784	0,01
Kinder Morgan, Inc.				
7,420 % éch. 15/02/2037		3 500	3 612	0,03
8,050 % éch. 15/10/2030		36	39	0,00
KKR Financial Holdings LLC				
5,400 % éch. 23/05/2033		10 400	9 713	0,09
KKR Group Finance Co. LLC				
3,625 % éch. 25/02/2050		1 300	897	0,01
Kraft Heinz Foods Co.				
4,125 % éch. 01/07/2027	£	6 150	7 078	0,07
Las Vegas Sands Corp.				
3,200 % éch. 08/08/2024	$	71 200	67 340	0,63
3,500 % éch. 18/08/2026		13 900	12 566	0,12
Lazard Group LLC				
4,375 % éch. 11/03/2029		4 968	4 598	0,04
Lehman Brothers Holdings, Inc.				
0,000 % éch. 23/12/2010 ^		900	3	0,00
5,259 % éch. 12/06/2013 ^	€	2 807	16	0,00
6,875 % éch. 02/05/2018 ^	$	3 000	11	0,00
Leidos, Inc.				
2,300 % éch. 15/02/2031		2 034	1 563	0,01
Level 3 Financing, Inc.				
3,625 % éch. 15/01/2029		700	514	0,00
3,875 % éch. 15/11/2029		4 000	3 164	0,03
Liberty Mutual Group, Inc.				
3,625 % éch. 23/05/2059	€	2 900	2 739	0,03
4,569 % éch. 01/02/2029	$	800	749	0,01
Marriott International, Inc.				
3,500 % éch. 15/10/2032		11 240	9 381	0,09
4,150 % éch. 01/12/2023		3 900	3 860	0,04
MassMutual Global Funding				
3,400 % éch. 08/03/2026		3 700	3 533	0,03
MetLife Capital Trust				
7,875 % éch. 15/12/2067		3 282	3 553	0,03
MetLife, Inc.				
5,875 % éch. 15/03/2028 (f)		7 400	7 077	0,07
Metropolitan Edison Co.				
3,500 % éch. 15/03/2023		6 900	6 878	0,07
4,000 % éch. 15/04/2025		6 300	6 034	0,06
Mid-America Apartments LP				
1,100 % éch. 15/09/2026		2 600	2 252	0,02
3,600 % éch. 01/06/2027		1 925	1 827	0,02
3,950 % éch. 15/03/2029		10 910	10 263	0,10
MID-Atlantic Interstate transmission LLC				
4,100 % éch. 15/05/2028		17 140	16 161	0,15
Midwest Connector Capital Co. LLC				
3,900 % éch. 01/04/2024		30 282	29 335	0,28
Mileage Plus Holdings LLC				
6,500 % éch. 20/06/2027		7 110	7 085	0,07
Mississippi Power Co.				
3,950 % éch. 30/03/2028		100	94	0,00
4,250 % éch. 15/03/2042		2 600	2 120	0,02
Monongahela Power Co.				
3,550 % éch. 15/05/2027		6 873	6 470	0,06
5,400 % éch. 15/12/2043		150	145	0,00
Morgan Stanley				
0,000 % éch. 02/04/2032 (i)		46 900	26 786	0,25
MPT Operating Partnership LP				
0,993 % éch. 15/10/2026	€	5 300	4 331	0,04
3,500 % éch. 15/03/2031	$	1 800	1 238	0,01
3,692 % éch. 05/06/2028	£	17 262	15 243	0,14
4,625 % éch. 01/08/2029	$	6 300	4 816	0,05
National Fuel Gas Co.				
2,950 % éch. 01/03/2031	$	3 700	$ 2 908	0,03
National Health Investors, Inc.				
3,000 % éch. 01/02/2031		1 800	1 302	0,01
Nationwide Financial Services, Inc.				
3,900 % éch. 30/11/2049		8 800	6 171	0,06
Nationwide Mutual Insurance Co.				
9,375 % éch. 15/08/2039		200	258	0,00
Netflix, Inc.				
3,625 % éch. 15/06/2030	€	29 473	29 016	0,28
3,875 % éch. 15/11/2029		26 450	26 460	0,25
4,625 % éch. 15/05/2029		6 000	6 307	0,06
Neuberger Berman Group LLC				
4,500 % éch. 15/03/2027	$	12 200	11 614	0,11
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
4,800 % éch. 01/12/2077		140	115	0,00
5,650 % éch. 01/05/2079		500	455	0,00
NGPL PipeCo LLC				
4,875 % éch. 15/08/2027		8 855	8 425	0,08
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
1,850 % éch. 16/09/2026		15 000	12 541	0,12
NVR, Inc.				
3,000 % éch. 15/05/2030		28 840	24 276	0,23
Oaktree Specialty Lending Corp.				
3,500 % éch. 25/02/2025		2 000	1 899	0,02
Omega Healthcare Investors, Inc.				
5,250 % éch. 15/01/2026		4 200	4 117	0,04
OneMain Finance Corp.				
6,875 % éch. 15/03/2025		5 400	5 200	0,05
ONEOK, Inc.				
4,350 % éch. 15/03/2029		21 030	19 479	0,18
6,100 % éch. 15/11/2032		4 300	4 313	0,04
Oracle Corp.				
3,850 % éch. 01/04/2060		1 800	1 204	0,01
4,100 % éch. 25/03/2061 (i)		6 600	4 612	0,04
6,250 % éch. 09/11/2032 (i)		14 500	15 222	0,14
Organon & Co.				
2,875 % éch. 30/04/2028	€	2 300	2 157	0,02
Pacific Gas & Electric Co.				
2,500 % éch. 01/02/2031	$	500	389	0,00
2,950 % éch. 01/03/2026 ^		6 700	6 148	0,06
3,000 % éch. 15/06/2028		16 330	14 149	0,13
3,150 % éch. 01/01/2026		10 399	9 674	0,09
3,250 % éch. 15/06/2023 ^		6 961	6 885	0,07
3,300 % éch. 15/03/2027 ^		11 935	10 634	0,10
3,300 % éch. 01/12/2027 ^		15 869	14 031	0,13
3,400 % éch. 15/08/2024 ^		9 676	9 291	0,09
3,450 % éch. 01/07/2025		5 877	5 569	0,05
3,500 % éch. 15/06/2025 ^		13 400	12 655	0,12
3,750 % éch. 15/02/2024 ^		3 683	3 609	0,03
3,750 % éch. 15/08/2042 ^		3 300	2 225	0,02
3,850 % éch. 15/11/2023 ^		5 177	5 105	0,05
4,000 % éch. 01/12/2046 ^		100	67	0,00
4,200 % éch. 01/06/2041		2 173	1 617	0,02
4,250 % éch. 01/08/2023		6 300	6 269	0,06
4,450 % éch. 15/04/2042 ^		8 543	6 390	0,06
4,500 % éch. 15/12/2041 ^		3 400	2 412	0,02
4,650 % éch. 01/08/2028		1 600	1 474	0,01
5,900 % éch. 15/06/2032		1 900	1 860	0,02
Pacific Life Global Funding				
1,200 % éch. 24/06/2025		8 100	7 350	0,07
Pactiv Evergreen Group Issuer LLC				
4,375 % éch. 15/10/2028		1 700	1 521	0,01
PECO Energy Co.				
3,000 % éch. 15/09/2049		200	137	0,00
Pennsylvania Electric Co.				
3,250 % éch. 15/03/2028		2 189	1 970	0,02
3,600 % éch. 01/06/2029		6 770	6 091	0,06
4,150 % éch. 15/04/2025		2 205	2 120	0,02
6,150 % éch. 01/10/2038		4 415	4 418	0,04
Penske Truck Leasing Co. LP				
3,350 % éch. 01/11/2029		17 110	14 442	0,14
Philip Morris International, Inc.				
5,625 % éch. 17/11/2029		6 800	6 914	0,07
Physicians Realty LP				
3,950 % éch. 15/01/2028		11 870	10 863	0,10
4,300 % éch. 15/03/2027		7 400	6 989	0,07

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Pioneer Natural Resources Co.				
7,200 % éch. 15/01/2028	$	2 500	2 652	0,03
Plains All American Pipeline LP				
6,700 % éch. 15/05/2036		300	292	0,00
Principal Life Global Funding				
3,000 % éch. 18/04/2026		5 700	5 295	0,05
Progress Energy, Inc.				
7,750 % éch. 01/03/2031		750	852	0,01
Protective Life Corp.				
3,400 % éch. 15/01/2030		21 300	18 571	0,18
Provident Funding Associates LP				
6,375 % éch. 15/06/2025		4 100	3 588	0,03
Realty Income Corp.				
2,200 % éch. 15/06/2028		5 000	4 291	0,04
4,875 % éch. 01/06/2026		3 471	3 456	0,03
Regency Centers LP				
2,950 % éch. 15/09/2029		1 200	1 010	0,01
Reliance Standard Life Global Funding				
2,750 % éch. 21/01/2027		6 100	5 509	0,05
Rio Oil Finance Trust				
8,200 % éch. 06/04/2028		3 873	3 930	0,04
9,250 % éch. 06/07/2024		2 446	2 482	0,02
9,750 % éch. 06/01/2027		173	180	0,00
Rockies Express Pipeline LLC				
4,800 % éch. 15/05/2030		6 600	5 819	0,06
S&P Global, Inc.				
4,250 % éch. 01/05/2029		13 610	13 020	0,12
4,750 % éch. 01/08/2028		2 600	2 575	0,02
Sabine Pass Liquefaction LLC				
4,200 % éch. 15/03/2028		5 700	5 368	0,05
5,000 % éch. 15/03/2027		7 300	7 169	0,07
5,750 % éch. 15/05/2024		2 548	2 550	0,02
Sabra Health Care LP				
3,200 % éch. 01/12/2031		4 050	3 023	0,03
Sammons Financial Group, Inc.				
4,450 % éch. 12/05/2027		700	655	0,01
San Diego Gas & Electric Co.				
3,750 % éch. 01/06/2047		100	78	0,00
4,100 % éch. 15/06/2049		3 400	2 786	0,03
Santander Holdings USA, Inc.				
2,490 % éch. 06/01/2028		4 600	3 953	0,04
3,244 % éch. 05/10/2026		2 500	2 324	0,02
3,500 % éch. 07/06/2024		9 500	9 235	0,09
4,500 % éch. 17/07/2025		4 000	3 914	0,04
SBA Tower Trust				
1,884 % éch. 15/07/2050		25 500	22 460	0,21
2,836 % éch. 15/01/2050		7 009	6 611	0,06
Sempra Energy				
4,125 % éch. 01/04/2052		4 100	3 195	0,03
SLM Corp.				
4,200 % éch. 29/10/2025		2 200	2 017	0,02
Southern California Edison Co.				
2,250 % éch. 01/06/2030		1 110	917	0,01
2,500 % éch. 01/06/2031		4 631	3 828	0,04
2,750 % éch. 01/02/2032		6 400	5 377	0,05
2,950 % éch. 01/02/2051		6 400	4 128	0,04
3,450 % éch. 01/02/2052		5 800	4 154	0,04
3,650 % éch. 01/06/2051		4 300	3 147	0,03
3,900 % éch. 01/12/2041		450	340	0,00
4,000 % éch. 01/04/2047		11 644	9 153	0,09
4,125 % éch. 01/03/2048		3 755	3 014	0,03
5,625 % éch. 01/02/2036		2 053	2 005	0,02
5,850 % éch. 01/11/2027		3 900	4 021	0,04
5,950 % éch. 01/02/2038		1 490	1 510	0,01
6,650 % éch. 01/04/2029		10 800	11 165	0,11
Southern Co.				
1,875 % éch. 15/09/2081	€	2 800	2 346	0,02
Southern Co. Gas Capital Corp.				
1,750 % éch. 15/01/2031	$	11 390	8 757	0,08
3,250 % éch. 15/06/2026		1 100	1 026	0,01
4,400 % éch. 30/05/2047		600	478	0,00
5,875 % éch. 15/03/2041		1 920	1 916	0,02
Southwest Airlines Co.				
5,125 % éch. 15/06/2027		7 600	7 516	0,07
Spirit AeroSystems, Inc.				
3,850 % éch. 15/06/2026		1 200	1 088	0,01
Spirit Airlines Pass-Through Trust				
4,100 % éch. 01/10/2029	$	2 525	2 253	0,02
Spirit Realty LP				
3,200 % éch. 15/01/2027		4 800	4 263	0,04
3,200 % éch. 15/02/2031		2 245	1 798	0,02
4,000 % éch. 15/07/2029		1 000	870	0,01
4,450 % éch. 15/09/2026		6 100	5 834	0,06
Sprint LLC				
7,875 % éch. 15/09/2023		4 300	4 370	0,04
Sprint Spectrum Co. LLC				
4,738 % éch. 20/09/2029		6 581	6 507	0,06
5,152 % éch. 20/09/2029		4 000	3 946	0,04
Standard Industries, Inc.				
2,250 % éch. 21/11/2026	€	14 450	13 253	0,13
STORE Capital Corp.				
2,750 % éch. 18/11/2030	$	2 000	1 540	0,01
4,500 % éch. 15/03/2028		800	723	0,01
4,625 % éch. 15/03/2029		2 100	1 886	0,02
Stryker Corp.				
1,950 % éch. 15/06/2030		9 650	7 879	0,07
Synchrony Bank				
5,625 % éch. 23/08/2027		7 550	7 369	0,07
Synchrony Financial				
3,950 % éch. 01/12/2027		5 200	4 646	0,04
Systems Energy Resources, Inc.				
2,140 % éch. 09/12/2025		17 300	15 840	0,15
T-Mobile USA, Inc.				
1,500 % éch. 15/02/2026		6 600	5 917	0,06
2,050 % éch. 15/02/2028		13 940	11 996	0,11
2,250 % éch. 15/11/2031		16 100	12 705	0,12
2,550 % éch. 15/02/2031		8 000	6 555	0,06
3,300 % éch. 15/02/2051		2 200	1 478	0,01
3,875 % éch. 15/04/2030		13 200	11 988	0,11
TD SYNNEX Corp.				
1,750 % éch. 09/08/2026		5 950	5 064	0,05
2,375 % éch. 09/08/2028		10 000	8 087	0,08
Teachers Insurance & Annuity Association of America				
4,375 % éch. 15/09/2054		18 200	17 420	0,17
Time Warner Cable Enterprises LLC				
8,375 % éch. 15/03/2023		11 512	11 585	0,11
8,375 % éch. 15/07/2033		400	446	0,00
Times Square Hotel Trust				
8,528 % éch. 01/08/2026		4 725	4 669	0,04
Trans-Allegheny Interstate Line Co.				
3,850 % éch. 01/06/2025		1 157	1 118	0,01
U.S. Airways Pass-Through Trust				
5,900 % éch. 01/04/2026		1 063	1 029	0,01
UDR, Inc.				
3,000 % éch. 15/08/2031		7 100	5 939	0,06
United Airlines Pass-Through Trust				
2,700 % éch. 01/11/2033		6 798	5 504	0,05
2,875 % éch. 07/04/2030		515	439	0,00
3,450 % éch. 01/06/2029		686	611	0,01
3,450 % éch. 07/01/2030		2 282	1 926	0,02
3,500 % éch. 01/09/2031		15 931	13 794	0,13
3,700 % éch. 01/09/2031		5 300	4 430	0,04
4,000 % éch. 11/10/2027		1 848	1 720	0,02
4,150 % éch. 11/10/2025		1 757	1 703	0,02
4,150 % éch. 25/02/2033		10 137	8 995	0,09
4,300 % éch. 15/02/2027		1 749	1 629	0,02
4,550 % éch. 25/02/2033		1 006	849	0,01
5,875 % éch. 15/04/2029		6 705	6 620	0,06
Venture Global Calcasieu Pass LLC				
3,875 % éch. 01/11/2033		7 800	6 386	0,06
Verizon Communications, Inc.				
2,100 % éch. 22/03/2028		1 400	1 217	0,01
2,355 % éch. 15/03/2032		736	585	0,01
5,113 % éch. 20/03/2026		1 400	1 366	0,01
5,706 % éch. 15/05/2025		6 800	6 858	0,06
VICI Properties LP				
3,875 % éch. 15/02/2029		7 400	6 496	0,06
4,250 % éch. 01/12/2026		5 200	4 863	0,05
4,500 % éch. 15/01/2028		4 200	3 877	0,04
4,625 % éch. 01/12/2029		2 825	2 575	0,02
5,750 % éch. 01/02/2027		2 000	1 952	0,02
Vistra Operations Co. LLC				
3,550 % éch. 15/07/2024		1 500	1 440	0,01
VMware, Inc.				
1,000 % éch. 15/08/2024	$	15 000	13 967	0,13
3,900 % éch. 21/08/2027		7 900	7 386	0,07
4,500 % éch. 15/05/2025		400	393	0,00
4,700 % éch. 15/05/2030		19 415	18 106	0,17
Volkswagen Group of America Finance LLC				
5,206 % éch. 07/06/2024		1 500	1 493	0,01
Walt Disney Co.				
2,200 % éch. 13/01/2028		5 959	5 313	0,05
Warnermedia Holdings, Inc.				
3,755 % éch. 15/03/2027		1 500	1 353	0,01
4,279 % éch. 15/03/2032		5 950	4 916	0,05
5,141 % éch. 15/03/2052		9 090	6 643	0,06
WEA Finance LLC				
3,750 % éch. 17/09/2024		8 000	7 566	0,07
Wells Fargo & Co.				
2,393 % éch. 02/06/2028		11 500	10 167	0,10
3,196 % éch. 17/06/2027		5 800	5 387	0,05
3,584 % éch. 22/05/2028		7 000	6 510	0,06
4,897 % éch. 25/07/2033		15 000	14 288	0,14
West Virginia United Health System Obligated Group				
3,129 % éch. 01/06/2050		1 500	968	0,01
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.				
4,400 % éch. 15/03/2024		8 860	8 720	0,08
4,950 % éch. 15/09/2028		8 150	7 840	0,07
Weyerhaeuser Co.				
4,000 % éch. 15/11/2029		4 820	4 411	0,04
4,000 % éch. 15/04/2030		1 114	1 017	0,01
6,875 % éch. 15/12/2033		649	699	0,01
7,350 % éch. 01/07/2026		12 350	12 980	0,12
7,375 % éch. 15/03/2032		2 889	3 203	0,03
Yellowstone Energy LP				
5,750 % éch. 31/12/2026		4 696	4 715	0,04
Zimmer Biomet Holdings, Inc.				
1,164 % éch. 15/11/2027	€	4 320	4 016	0,04
2,425 % éch. 13/12/2026		4 500	4 548	0,04
			3 024 996	28,69
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Advantage Sales & Marketing, Inc.				
8,284 % éch. 28/10/2027	$	7 976	6 626	0,06
Arches Buyer, Inc.				
7,634 % éch. 06/12/2027		14 959	13 889	0,13
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC				
6,603 % éch. 01/12/2027		10 954	10 949	0,10
Catalent Pharma Solutions, Inc.				
6,375 % éch. 22/02/2028		1 477	1 457	0,01
Charter Communications Operating LLC				
6,140 % éch. 01/02/2027		4 659	4 556	0,04
Chobani LLC				
7,884 % éch. 25/10/2027		489	481	0,01
E.W. Scripps Co.				
7,134 % éch. 07/01/2028		2 795	2 725	0,03
FinCo LLC				
6,884 % éch. 27/06/2025		5 415	5 405	0,05
GIP II Blue Holding LP				
9,230 % éch. 29/09/2028		11 803	11 721	0,11
INEOS Finance PLC				
3,898 % éch. 01/04/2024	€	11 099	11 824	0,11
IQVIA, Inc.				
4,202 % éch. 07/03/2024		1 000	1 068	0,01
Level 3 Financing, Inc.				
6,134 % éch. 01/03/2027	$	10 305	9 901	0,09
MH Sub LLC				
8,134 % éch. 13/09/2024		20 277	19 741	0,19
Organon & Co.				
7,750 % éch. 02/06/2028		15	15	0,00
Parexel International Corp.				
7,634 % éch. 15/11/2028		1 687	1 629	0,02
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				
8,165 % éch. 16/11/2025		6 144	5 807	0,06
Reynolds Group Holdings, Inc.				
7,634 % éch. 24/09/2028		691	683	0,01
Scientific Games Holdings LP				
5,185 % éch. 04/04/2029	€	1 000	1 020	0,01
7,097 % éch. 04/04/2029	$	1 496	1 431	0,01

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
SkyMiles IP Ltd.			
7,993 % éch. 20/10/2027	$ 12 200	$ 12 459	0,12
Tibco Software, Inc.			
9,180 % éch. 30/03/2029	6 000	5 373	0,05
Trans Union LLC			
6,634 % éch. 01/12/2028	1 991	1 975	0,02
USI, Inc.			
7,980 % éch. 02/12/2026	1 940	1 931	0,02
		132 666	1,26
OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX			
Obligations Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010			
6,725 % éch. 01/04/2035	100	102	0,00
7,350 % éch. 01/07/2035	464	489	0,01
Obligations Metropolitan Transportation Authority, New York Revenue Bonds, (BABs), Series 2010			
6,814 % éch. 15/11/2040	8 700	9 115	0,09
Obligations Municipal Electric Authority of Georgia Revenue Bonds, (BABs), Series 2010			
6,637 % éch. 01/04/2057	193	207	0,00
Obligations New York City Transitional Finance Authority Future Tax Secured, New York Revenue Bonds, Series 2010			
5,267 % éch. 01/05/2027	2 200	2 221	0,02
Billets State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020			
1,258 % éch. 01/07/2025	25 400	23 333	0,22
1,705 % éch. 01/07/2027	17 100	14 901	0,14
		50 368	0,48
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
American Home Mortgage Assets Trust			
2,988 % éch. 25/10/2046	6 624	4 618	0,05
Banc of America Funding Trust			
4,496 % éch. 20/09/2034	1	1	0,00
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust			
5,318 % éch. 15/10/2037	4 423	4 259	0,04
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
3,743 % éch. 25/01/2035	317	292	0,00
3,992 % éch. 25/08/2035 ^	38	35	0,00
4,089 % éch. 25/02/2034	4	4	0,00
4,191 % éch. 25/11/2034	118	106	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust			
3,668 % éch. 25/11/2036 ^	417	194	0,00
4,709 % éch. 25/06/2046 ^	2 195	1 829	0,02
BWAY Mortgage Trust			
2,809 % éch. 10/03/2033	285	272	0,00
Chase Mortgage Finance Trust			
3,788 % éch. 25/02/2037	8	7	0,00
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates			
4,619 % éch. 25/10/2035	70	64	0,00
4,669 % éch. 25/01/2035	90	83	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
3,790 % éch. 25/09/2035	11	11	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust			
3,398 % éch. 25/08/2035 ^	1 802	1 486	0,02
4,563 % éch. 20/07/2046 ^	4 497	3 344	0,03
4,949 % éch. 25/02/2037	38	31	0,00
5,009 % éch. 25/08/2035 ^	475	405	0,01
5,089 % éch. 25/12/2035 ^	1 331	1 107	0,01
5,750 % éch. 25/04/2047 ^	580	334	0,00
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
2,984 % éch. 25/01/2036 ^	183	164	0,00
3,792 % éch. 25/11/2034	19	17	0,00
4,849 % éch. 25/05/2035	4	3	0,00
5,500 % éch. 25/10/2034	406	388	0,00
5,500 % éch. 25/07/2035	38	21	0,00
5,500 % éch. 25/12/2035	170	129	0,00
5,500 % éch. 25/12/2035 ^	88	67	0,00
5,910 % éch. 20/02/2036 ^	18	15	0,00
6,000 % éch. 25/11/2037 ^	27	15	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
3,187 % éch. 25/06/2033	4	4	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates			
3,139 % éch. 25/07/2033	3	3	0,00
6,500 % éch. 25/12/2033	13	12	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates			
3,240 % éch. 26/06/2037	$ 4 901	$ 4 629	0,05
Credit Suisse Mortgage Capital Trust			
3,197 % éch. 27/05/2037	3 745	2 475	0,02
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust			
4,529 % éch. 25/07/2047	438	386	0,00
GSC Capital Corp. Mortgage Trust			
4,749 % éch. 25/05/2036 ^	421	383	0,00
GSMPS Mortgage Loan Trust			
4,739 % éch. 25/01/2036	2 010	1 662	0,02
GSR Mortgage Loan Trust			
3,760 % éch. 25/04/2032	105	89	0,00
3,955 % éch. 25/09/2035	1	1	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust			
3,417 % éch. 19/04/2034	6	5	0,00
4,529 % éch. 19/08/2037	4 561	3 914	0,04
4,749 % éch. 19/12/2036	3 201	2 639	0,03
5,033 % éch. 20/06/2035	1 589	1 418	0,01
HomeBanc Mortgage Trust			
4,889 % éch. 25/03/2035	294	245	0,00
Impac CMB Trust			
5,089 % éch. 25/03/2035	185	172	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust			
3,082 % éch. 25/03/2036	741	522	0,01
JPMorgan Alternative Loan Trust			
5,843 % éch. 26/05/2037	225	175	0,00
JPMorgan Mortgage Trust			
4,001 % éch. 25/07/2035	19	18	0,00
Lehman Mortgage Trust			
5,750 % éch. 25/02/2037 ^	1 457	1 008	0,01
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust			
3,874 % éch. 21/11/2034	6	5	0,00
MASTR Alternative Loan Trust			
5,500 % éch. 25/02/2034	14	13	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
2,969 % éch. 25/05/2033	2	2	0,00
3,046 % éch. 25/02/2035	18	17	0,00
3,455 % éch. 25/05/2036	326	289	0,00
5,049 % éch. 25/06/2028	1	1	0,00
5,905 % éch. 25/01/2029	110	106	0,00
6,000 % éch. 25/04/2036 ^	36	18	0,00
MortgageIT Trust			
5,129 % éch. 25/12/2034	94	92	0,00
NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates			
4,839 % éch. 25/02/2035 ^	242	213	0,00
Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
3,548 % éch. 25/08/2035	182	149	0,00
4,809 % éch. 25/04/2046	5 463	1 620	0,02
6,000 % éch. 25/02/2037 ^	2 727	2 088	0,02
Residential Asset Securitization Trust			
6,500 % éch. 25/04/2037 ^	2 115	572	0,01
Sequoia Mortgage Trust			
4,753 % éch. 20/05/2035	144	124	0,00
5,235 % éch. 20/05/2034	498	462	0,01
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
3,854 % éch. 25/04/2035	200	186	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust			
3,508 % éch. 25/03/2046	188	177	0,00
4,769 % éch. 25/07/2046 ^	179	124	0,00
4,809 % éch. 25/04/2036	112	96	0,00
4,809 % éch. 25/05/2036	9	7	0,00
4,839 % éch. 19/07/2035	1	1	0,00
4,949 % éch. 25/02/2036 ^	17	13	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates			
3,783 % éch. 25/07/2033	172	161	0,00
5,041 % éch. 25/06/2033	2	2	0,00
Thornburg Mortgage Securities Trust			
2,994 % éch. 25/09/2037	244	235	0,00
Towd Point Mortgage Trust			
2,750 % éch. 25/06/2057	4 740	4 517	0,04
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
1,989 % éch. 25/11/2041	165	143	0,00
2,868 % éch. 25/03/2035	54	53	0,00
3,048 % éch. 25/08/2046	6	6	0,00
4,759 % éch. 25/05/2034	1 669	1 562	0,02
4,929 % éch. 25/12/2045	5	4	0,00
5,009 % éch. 25/01/2045	14	13	0,00
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
2,888 % éch. 25/11/2046 ^	$ 2 130	$ 1 692	0,02
4,769 % éch. 25/06/2037	3 252	2 869	0,03
Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
3,984 % éch. 25/06/2033	72	67	0,00
Wells Fargo Alternative Loan Trust			
3,563 % éch. 25/07/2037 ^	145	127	0,00
4,929 % éch. 25/03/2037 ^	1 201	1 052	0,01
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust			
4,046 % éch. 25/08/2036 ^	302	277	0,00
		58 216	0,55
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Fannie Mae			
1,916 % éch. 01/01/2037	0	0	0,00
2,003 % éch. 01/02/2037	1	1	0,00
2,073 % éch. 01/03/2037	24	24	0,00
2,375 % éch. 01/03/2037	0	0	0,00
2,530 % éch. 01/04/2037	0	0	0,00
2,888 % éch. 01/06/2043	8	8	0,00
2,889 % éch. 01/10/2044	5	5	0,00
2,961 % éch. 25/09/2027	746	704	0,01
3,585 % éch. 01/12/2034	16	16	0,00
3,821 % éch. 25/07/2037	2	2	0,00
4,035 % éch. 01/10/2037	0	0	0,00
4,042 % éch. 01/10/2036	0	0	0,00
4,158 % éch. 01/09/2037	1	1	0,00
4,366 % éch. 25/09/2042	19	19	0,00
4,451 % éch. 01/09/2037	2	2	0,00
4,739 % éch. 25/05/2042	6	6	0,00
5,289 % éch. 25/04/2032	1	1	0,00
5,500 % éch. 25/05/2036	289	294	0,00
6,625 % éch. 15/11/2030	17 025	19 977	0,19
Freddie Mac			
1,021 % éch. 25/08/2029 (a)	2 907	147	0,00
1,944 % éch. 01/01/2037	0	0	0,00
2,222 % éch. 01/06/2037	0	0	0,00
2,309 % éch. 01/03/2037	2	2	0,00
2,315 % éch. 01/03/2036	1	1	0,00
2,410 % éch. 01/04/2037	0	0	0,00
2,660 % éch. 01/03/2036	0	0	0,00
2,889 % éch. 25/02/2045	18	18	0,00
4,008 % éch. 01/10/2038	0	0	0,00
4,500 % éch. 01/01/2040	31	31	0,00
5,992 % éch. 25/11/2055	5 956	3 661	0,04
Ginnie Mae, TBA			
4,000 % éch. 01/01/2053	3 000	2 839	0,03
Administration des petites entreprises			
4,720 % éch. 01/02/2024	10	10	0,00
5,240 % éch. 01/08/2023	8	8	0,00
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)			
3,000 % éch. 01/06/2042 - 01/10/2046	36 592	33 326	0,32
3,500 % éch. 01/10/2045	3 437	3 198	0,03
4,000 % éch. 01/05/2030 - 01/11/2041	205	197	0,00
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
3,000 % éch. 01/02/2053	8 600	7 556	0,07
3,500 % éch. 01/02/2053	158 922	144 492	1,37
4,000 % éch. 01/03/2053	579 500	543 827	5,16
		760 373	7,22
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Obligations du Trésor américain			
1,375 % éch. 15/11/2040	149 120	97 027	0,92
1,750 % éch. 15/08/2041	81 800	56 018	0,53
1,875 % éch. 15/02/2041	297 100	210 152	1,99
1,875 % éch. 15/11/2051	164 371	104 164	0,99
2,000 % éch. 15/11/2041	189 400	135 328	1,28
2,250 % éch. 15/05/2041	68 000	51 157	0,49
2,250 % éch. 15/08/2046	220	156	0,00
2,250 % éch. 15/02/2052	70 400	48 983	0,46
2,375 % éch. 15/02/2042	53 700	41 027	0,39
2,500 % éch. 15/02/2045	28 750	21 672	0,21
2,750 % éch. 15/11/2047	1 133	885	0,01
2,875 % éch. 15/11/2046	1 461	1 172	0,01
2,875 % éch. 15/05/2049	6 555	5 278	0,05
2,875 % éch. 15/05/2052	130 500	104 604	0,99

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
3,000 % éch. 15/05/2045	$ 32 725	$ 26 992	0,26
3,000 % éch. 15/02/2048	40 992	33 626	0,32
3,125 % éch. 15/08/2044	25 700	21 740	0,21
3,125 % éch. 15/05/2048	29 360	24 690	0,23
3,250 % éch. 15/05/2042	141 316	123 961	1,18
3,375 % éch. 15/08/2042	2 000	1 788	0,02
Billets du Trésor américain			
3,875 % éch. 30/09/2029	206 000	204 568	1,94
STRIPS du Trésor américain			
0,000 % éch. 15/05/2043 (d)	25	11	0,00
		1 314 999	12,48

	ACTIONS		
BONS DE SOUSCRIPTION			
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31/12/2060	7 228	0	0,00
Total États-Unis		5 396 303	51,20

	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
ÎLES VIERGES BRITANNIQUES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Champion Path Holdings Ltd.			
4,500 % éch. 27/01/2026	$ 9 900	8 644	0,08
4,850 % éch. 27/01/2028	13 700	11 559	0,11
CLP Power Hong Kong Financing Ltd.			
2,125 % éch. 30/06/2030	16 900	13 682	0,13
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.			
6,125 % éch. 15/05/2029	3 800	3 849	0,04
JMH Co. Ltd.			
2,500 % éch. 09/04/2031	4 900	4 004	0,04
Total Îles Vierges britanniques		41 738	0,40
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BILLETS DE TRÉSORERIE			
American Electric Power Co., Inc.			
4,730 % éch. 05/01/2023	4 100	4 097	0,04
4,800 % éch. 19/01/2023	10 000	9 974	0,09
Baxter International, Inc.			
4,730 % éch. 23/01/2023	6 900	6 879	0,06
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.			
4,800 % éch. 18/01/2023	2 300	2 294	0,02
4,800 % éch. 20/01/2023	4 300	4 288	0,04
Constellation Brands, Inc.			
5,000 % éch. 09/01/2023	7 400	7 390	0,07
5,000 % éch. 10/01/2023	10 500	10 484	0,10
5,000 % éch. 17/01/2023	2 300	2 294	0,02
Crown Castle International Corp.			
5,000 % éch. 04/01/2023	$ 2 800	$ 2 798	0,03
5,150 % éch. 10/01/2023	1 000	998	0,01
Dominion Resources, Inc.			
4,750 % éch. 31/01/2023	1 450	1 444	0,01
Duke Energy Corp.			
4,620 % éch. 11/01/2023	1 000	998	0,01
4,620 % éch. 17/01/2023	2 500	2 494	0,02
4,650 % éch. 09/01/2023	6 900	6 891	0,07
Électricité de France S.A.			
5,000 % éch. 20/01/2023	20 000	19 946	0,19
Enbridge, Inc.			
4,750 % éch. 09/01/2023	3 200	3 196	0,03
4,780 % éch. 20/01/2023	2 400	2 393	0,02
Entergy Corp.			
4,750 % éch. 11/01/2023	6 300	6 290	0,06
Fiserv, Inc.			
4,820 % éch. 01/02/2023	3 000	2 987	0,03
Humana, Inc.			
4,850 % éch. 25/01/2023	7 000	6 976	0,07
Medtronic Global Holdings S.C.A.			
4,750 % éch. 27/01/2023	13 600	13 553	0,13
Mercedes-Benz Finance North America LLC			
4,800 % éch. 30/01/2023	5 000	4 980	0,05
Mondelez International, Inc.			
4,530 % éch. 04/01/2023	3 300	3 298	0,03
Oracle Corp.			
4,800 % éch. 26/01/2023	5 000	4 983	0,05
Parker-Hannifin Corp.			
4,620 % éch. 01/02/2023	3 435	3 421	0,03
4,700 % éch. 18/01/2023	1 800	1 796	0,02
4,700 % éch. 19/01/2023	1 800	1 796	0,02
Quanta Services, Inc.			
5,100 % éch. 09/01/2023	3 700	3 695	0,03
Republic Services, Inc.			
4,650 % éch. 12/01/2023	1 450	1 448	0,01
Tampa Electric Co.			
4,800 % éch. 12/01/2023	13 500	13 478	0,13
Thomson Reuters Corp.			
4,770 % éch. 25/01/2023	31 300	31 199	0,30
Virginia Electric & Power Co.			
4,720 % éch. 06/02/2023	5 300	5 275	0,05
Vodafone Group PLC			
4,600 % éch. 05/01/2023	8 200	8 194	0,08
VW Credit, Inc.			
4,800 % éch. 26/01/2023	30 900	30 791	0,29
Walgreens Boots Alliance, Inc.			
4,900 % éch. 11/01/2023	$ 1 500	$ 1 498	0,01
4,950 % éch. 18/01/2023	13 600	13 566	0,13
		248 082	2,35
BONS DU TRÉSOR HONGROIS			
18,250 % éch. 03/01/2023 (d)(e)	HUF 22 046 000	58 755	0,56
Total des Instruments à court terme		306 837	2,91
Total des Valeurs mobilières		$ 9 778 544	92,78

	ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (g)	3 787 451	33 329	0,32
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)	11 356 637	103 686	0,98
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (g)	3 637 652	38 357	0,36
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	60 506 501	602 282	5,72
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (g)	329 257	4 386	0,04
		782 040	7,42
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)	2 587 040	256 286	2,43
Total des Fonds d'investissement		$ 1 038 326	9,85

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
DEU	4,230 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 30 800	Obligations du Trésor américain 2,750 % échéance 15/11/2047	$ (31 422)	$ 30 800	$ 30 814	0,29
FICC	1,900	30/12/2022	03/01/2023	29 223	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 08/06/2023	(29 808)	29 223	29 226	0,28
SAL	4,320	30/12/2022	03/01/2023	15 400	Billets du Trésor américain 0,125 % échéance 15/10/2023	(15 695)	15 400	15 407	0,15
Total des Contrats de mise en pension						**$ (76 925)**	**$ 75 423**	**$ 75 447**	**0,72**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Long	03/2024	836	$ 390	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Long	06/2023	836	(11)	0,00
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	135	108	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	Long	03/2023	443	(3 821)	(0,04)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Long	03/2023	3 494	(34 124)	(0,31)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars	Long	03/2023	2 113	(3 144)	(0,03)

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	135	$ (690)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	302	(182)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Long	03/2023	575	(119)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	1 653	815	0,01
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Long	03/2023	402	(2 933)	(0,03)
				$ (43 711)	(0,41)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ (43 711)**	**(0,41)**

(1) Option de style contrat à terme standardisé.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Toll Brothers Finance Corp.	(1,000) %	20/06/2024	$ 23 500	$ (14)	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[2]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AES Corp.	5,000 %	20/12/2025	$ 7 900	$ (652)	(0,01)
AES Corp.	5,000	20/06/2026	2 400	(184)	0,00
Airbus Finance BV	1,000	20/12/2025	€ 10 300	(67)	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20/12/2027	$ 8 000	66	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2023	12 100	(134)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2024	3 400	6	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2024	7 600	(116)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2025	2 000	(23)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	68 000	(1 073)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2026	1 300	(21)	0,00
Atlantia SpA	1,000	20/12/2025	€ 1 800	37	0,00
Auchan Holding S.A.	1,000	20/12/2027	300	0	0,00
Berkshire Hathaway, Inc.	1,000	20/06/2023	$ 7 100	81	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2023	7 300	(11)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2025	7 000	74	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2025	900	9	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2026	1 000	(2)	0,00
BP Capital Markets PLC	1,000	20/12/2025	€ 6 800	(61)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2024	23 900	(100)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2025	6 000	(47)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2027	500	(6)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/06/2028	20 400	(674)	(0,01)
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2028	1 100	(35)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20/12/2024	$ 5 000	(353)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2023	12 050	(28)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2023	42 850	2 076	0,02
General Electric Co.	1,000	20/06/2024	32 050	288	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2024	27 900	555	0,01
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	18 750	(110)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2026	2 000	(13)	0,00
General Motors Co.	5,000	20/12/2026	5 300	(480)	(0,01)
Hess Corp.	1,000	20/06/2026	7 000	50	0,00
International Lease Finance Corp.	5,000	20/12/2023	6 100	(649)	(0,01)
Lennar Corp.	5,000	20/12/2026	3 200	(219)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20/12/2023	11 000	394	0,00
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20/06/2026	11 300	(98)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/06/2024	€ 25 300	(553)	(0,01)
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2024	47 100	(1 231)	(0,01)
Southwest Airlines Co.	1,000	20/12/2026	$ 3 100	15	0,00
Stellantis NV	5,000	20/06/2026	€ 16 100	(1 772)	(0,02)
Stellantis NV	5,000	20/12/2026	8 800	(807)	(0,01)
Syngenta Finance NV	1,000	20/06/2028	2 600	(53)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20/06/2026	17 000	(231)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20/06/2028	7 800	(219)	0,00
Tesco PLC	1,000	20/12/2024	63 700	430	0,00
Tesco PLC	1,000	20/12/2027	4 700	(88)	0,00
Tesco PLC	1,000	20/06/2028	7 300	(241)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2026	$ 1 900	(42)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2027	3 000	(3)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2027	5 000	52	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20/06/2023	€ 26 100	(115)	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20/06/2024	12 700	(51)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20/12/2026	4 100	(142)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20/06/2028	11 100	(372)	0,00
				$ (6 943)	(0,07)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[2]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000 %	20/12/2027	$ 149 300	$ 81	0,00
Indice iTraxx Crossover 38 à 5 ans	5,000	20/12/2027	€ 12 900	610	0,01
				$ 691	0,01

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	1,060 %	21/02/2052	£ 3 000	$ (1 533)	(0,02)
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	1,101	21/02/2052	7 700	(3 863)	(0,04)
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	1,175	28/02/2052	10 300	(4 991)	(0,05)
À payer[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250	15/03/2028	37 200	(1 316)	(0,01)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2023	¥ 910 000	17	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/09/2024	1 829 900	61	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	18/12/2029	5 198 520	(2 548)	(0,03)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,300	20/03/2028	7 992 900	1 184	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2027	$ 382 600	34 368	0,33
À recevoir[4]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,450	20/12/2024	427 700	6 416	0,06
À payer	CDI BRL à 1 an	11,224	04/01/2027	BRL 245 400	(1 849)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,245	04/01/2027	119 000	(861)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,445	02/01/2025	40 000	160	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,572	04/01/2027	37 000	(201)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,715	04/01/2027	55 200	(257)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,980	04/01/2027	522 800	1 082	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	13,026	02/01/2025	1 882 900	1 952	0,02
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	1,500	17/06/2030	CAD 262 700	(18 278)	(0,17)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	€ 31 200	(1 344)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027	88 900	(9 117)	(0,09)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027	20 800	(2 087)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	62 700	(5 544)	(0,05)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	28 000	(2 474)	(0,02)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	81 400	(2 518)	(0,02)
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,000	19/09/2023	HUF 37 770 400	(11 356)	(0,11)
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,250	19/09/2023	16 157 700	(5 518)	(0,05)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,400	05/03/2026	MXN 1 762 000	(9 462)	(0,09)
					$ (39 877)	(0,38)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ (46 143)**	**(0,44)**

(1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,000 %	15/03/2023	53 270	$ 6 064	$ 28 860	0,27
JPM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,000	15/03/2023	35 260	3 892	19 102	0,18
							$ 9 956	$ 47 962	0,45

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente - Indice iTraxx Europe 37 à 5 ans hors cote	Vente	3,000 %	15/03/2023	26 000	$ (46)	$ (5)	0,00

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,870 %	23/01/2023	5 700	$ (42)	$ (17)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,320	23/01/2023	5 700	(42)	(71)	0,00
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,900	17/01/2023	10 500	(43)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	17/01/2023	10 500	(43)	(176)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,175	15/03/2023	159 840	(5 929)	(49 124)	(0,47)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,610	17/01/2023	5 200	(48)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,110	17/01/2023	5 200	(48)	(149)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	12/01/2023	13 200	(74)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,550	12/01/2023	13 200	(74)	(110)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547	07/03/2023	24 000	(528)	(54)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	24 000	(527)	(1 511)	(0,02)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	32 700	(382)	(84)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	32 700	(452)	(1 070)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,740	19/01/2023	5 000	(43)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,180	19/01/2023	5 000	(43)	(112)	0,00
JPM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,175	15/03/2023	105 770	(3 823)	(32 507)	(0,31)
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,070	23/01/2023	10 800	(53)	(9)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,520	23/01/2023	10 800	(53)	(128)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,600	17/01/2023	5 300	(40)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,050	17/01/2023	5 300	(40)	(194)	0,00
							$ (12 327)	$ (85 325)	(0,81)

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	$ 101,891	05/01/2023	8 200	$ (24)	$ 0	0,00
JPM	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	99,000	06/03/2023	23 500	(173)	(59)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	98,766	06/03/2023	5 700	(48)	(78)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	100,766	06/03/2023	5 700	(41)	(19)	0,00
SAL	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	101,859	05/01/2023	9 800	(29)	0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	99,750	06/02/2023	10 800	(76)	(65)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	101,750	06/02/2023	10 800	(63)	(25)	0,00
					$ (454)	$ (246)	0,00

[1] Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000 %	20/06/2026	$ 1 100	$ (38)	$ 9	$ (29)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2024	14 500	(304)	467	163	0,00
	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	14 200	(395)	464	69	0,00
BRC	Huarong Finance Co. Ltd.	1,000	20/12/2024	23 000	(471)	(189)	(660)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2024	13 500	(294)	445	151	0,00
	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/12/2024	19 100	54	216	270	0,01
	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	49 700	(1 207)	1 448	241	0,00
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20/12/2025	7 800	170	(59)	111	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2024	31 400	(1 186)	1 017	(169)	0,00
CBK	Intrum AB	5,000	20/12/2024	€ 3 000	286	(357)	(71)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	$ 11 100	(270)	324	54	0,00
DUB	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2025	5 700	(5)	84	79	0,00
FBF	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/12/2024	3 000	7	35	42	0,00
	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	13 000	(201)	348	147	0,00
GLM	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	44 900	(502)	1 225	723	0,01
GST	Equinix, Inc.	5,000	20/06/2027	4 500	629	(9)	620	0,01
	Intrum AB	5,000	20/12/2024	€ 34 400	4 118	(4 935)	(817)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2025	$ 5 700	(7)	86	79	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/12/2026	1 400	33	(9)	24	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2024	5 700	(229)	198	(31)	0,00
JLN	Intrum AB	5,000	20/12/2024	€ 10 000	1 189	(1 426)	(237)	0,00
JPM	Hochtief AG	5,000	20/12/2025	29 400	6 790	(3 823)	2 967	0,03
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20/06/2024	$ 16 300	223	(66)	157	0,00
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20/12/2024	8 100	112	(15)	97	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2025	7 600	(1)	107	106	0,00
MYC	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2027	15 800	(978)	173	(805)	(0,01)
	Brookfield Asset Management, Inc.	1,000	20/06/2025	7 900	0	(110)	(110)	0,00
	Consolidated Edison Co. of New York, Inc.	1,000	20/12/2024	16 500	322	(63)	259	0,00
	Pioneer Natural Resources Co.	1,000	20/06/2025	8 400	(408)	515	107	0,00
MYI	Intrum AB	5,000	20/12/2024	€ 2 700	311	(375)	(64)	0,00
					$ 7 748	$ (4 275)	$ 3 473	0,03

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000 %	20/12/2023	$ 5 800	$ 676	$ (424)	$ 252	0,00
BRC	Indice iTraxx Japan 38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	¥ 5 902 209	(152)	444	292	0,00
CBK	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000	20/12/2023	$ 8 000	828	(481)	347	0,01
GST	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000	20/12/2023	24 000	2 849	(1 807)	1 042	0,01
	Indice iTraxx Japan 38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	¥ 2 529 518	(97)	222	125	0,00
JPM	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000	20/12/2023	$ 44 300	5 450	(3 526)	1 924	0,02
	Indice iTraxx Japan 38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	¥ 10 517 273	(300)	821	521	0,01
MYC	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000	20/12/2023	$ 6 600	784	(497)	287	0,00
					$ 10 038	$ (5 248)	$ 4 790	0,05

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	CHF	1 977	$	2 103	$ 0	$ (35)	$ (35)	0,00
	01/2023	€	2		2	0	0	0	0,00
	01/2023	£	1 445		1 753	15	0	15	0,00
	01/2023	HUF	9 429 734		24 075	0	(1 057)	(1 057)	(0,01)
	01/2023	PEN	7 411		1 951	9	0	9	0,00
	01/2023		2 729	CHF	2 582	64	0	64	0,00
	01/2023		27 692	£	22 839	0	(215)	(215)	0,00
	01/2023		39	HUF	17 803	8	0	8	0,00
	01/2023	ZAR	77 762	$	4 376	0	(193)	(193)	0,00
	02/2023	$	11 015	NOK	109 331	102	0	102	0,00
	02/2023	ZAR	93 342	$	5 208	0	(257)	(257)	0,00
	03/2023		170 589		9 661	0	(307)	(307)	0,00
BOM	01/2023	CAD	56 142		41 810	374	0	374	0,00
BPS	01/2023	€	12 001	$	12 793	0	(21)	(21)	0,00
	01/2023	HUF	3 344 873		8 572	0	(343)	(343)	0,00
	01/2023	$	4 183	ZAR	72 718	89	0	89	0,00
	02/2023		1 917	IDR	30 149 375	32	0	32	0,00
	02/2023	ZAR	163 442	$	9 105	0	(468)	(468)	0,00
	03/2023	PEN	122 503		31 508	0	(405)	(405)	0,00
	03/2023	$	2 506	COP	12 262 091	0	(10)	(10)	0,00
	03/2023		1 617	INR	134 142	0	(4)	(4)	0,00
	03/2023		512	MXN	10 313	10	0	10	0,00
	04/2023		2 596	CLP	2 377 941	153	0	153	0,00
BRC	01/2023	HUF	959 129	$	2 501	0	(55)	(55)	0,00
	01/2023	$	3 114	PEN	11 995	25	0	25	0,00
BSH	01/2023	CAD	2 771	$	2 034	0	(11)	(11)	0,00
CBK	01/2023		2 984		2 205	3	0	3	0,00
	01/2023	CLP	17 541 513		19 718	0	(855)	(855)	(0,01)
	01/2023	€	13 677		14 541	0	(62)	(62)	0,00
	01/2023	HUF	346 245		868	0	(52)	(52)	0,00
	01/2023	$	4 221	BRL	22 155	0	(25)	(25)	0,00
	01/2023		24 713	CHF	23 343	533	0	533	0,01
	01/2023		18 403	CLP	17 535 597	2 165	0	2 165	0,02
	01/2023		20 718	€	19 583	191	0	191	0,00
	01/2023		9 858	PEN	39 233	411	0	411	0,00
	01/2023	ZAR	106 760	$	6 093	0	(170)	(170)	0,00
	02/2023	NOK	22 940		2 347	14	0	14	0,00
	02/2023	PEN	137 357		34 418	0	(1 493)	(1 493)	(0,01)
	02/2023	$	6 190	BRL	33 406	103	0	103	0,00
	02/2023		19 718	CLP	17 638 133	870	0	870	0,01
	03/2023	PEN	153 584	$	38 363	0	(1 609)	(1 609)	(0,02)
	03/2023	$	41 497	MXN	814 103	0	(295)	(295)	0,00
	05/2023	PEN	41 350	$	10 324	0	(410)	(410)	0,00
	07/2023	$	12 363	PEN	50 187	608	0	608	0,01
CLY	01/2023	HUF	3 453 683	$	8 782	0	(423)	(423)	0,00
	01/2023	$	1 218	HUF	468 104	29	0	29	0,00
	03/2023		7 326	CLP	6 648 027	404	0	404	0,00
	03/2023		2 525	PEN	9 714	5	0	5	0,00
DUB	01/2023	DKK	86 439	$	12 183	0	(228)	(228)	0,00
	01/2023	HUF	7 289 225		16 121	0	(3 249)	(3 249)	(0,03)
	02/2023	ZAR	13 423		804	18	0	18	0,00
	03/2023	$	5 945	PEN	22 810	0	(3)	(3)	0,00
GLM	01/2023	BRL	22 155	$	4 157	0	(39)	(39)	0,00
	01/2023	CNH	102		15	0	0	0	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	01/2023	HUF	4 935 889	$	12 639	$ 0	$ (515)	$ (515)	(0,01)
	01/2023	PEN	25 239		6 516	0	(88)	(88)	0,00
	01/2023	PLN	1 587		313	0	(49)	(49)	0,00
	01/2023	ZAR	95 355		5 334	0	(262)	(262)	0,00
	02/2023	$	25 574	COP	116 484 309	0	(1 771)	(1 771)	(0,02)
	03/2023	COP	12 262 091	$	2 543	47	0	47	0,00
	03/2023	MXN	1 057 412		51 437	0	(2 079)	(2 079)	(0,02)
	03/2023	$	2 541	COP	12 262 091	0	(45)	(45)	0,00
	04/2023		4 084	BRL	22 155	40	0	40	0,00
	05/2023	PEN	174 054	$	43 642	0	(1 522)	(1 522)	(0,02)
	05/2023	ZAR	23 592		1 412	40	0	40	0,00
JPM	01/2023	HUF	298 983		763	0	(34)	(34)	0,00
	02/2023	$	3 305	IDR	52 074 742	62	0	62	0,00
	02/2023	ZAR	469	$	26	0	(1)	(1)	0,00
	03/2023	$	3 552	IDR	55 599 667	42	0	42	0,00
	03/2023		1 778	MXN	35 326	10	0	10	0,00
MBC	01/2023	AUD	3 747	$	2 512	0	(30)	(30)	0,00
	01/2023	CAD	2 424		1 780	0	(10)	(10)	0,00
	01/2023	DKK	78 166		11 042	0	(182)	(182)	0,00
	01/2023	€	57 384		60 266	0	(1 003)	(1 003)	(0,01)
	01/2023	¥	588 000		4 340	0	(120)	(120)	0,00
	01/2023	$	6 933	CAD	9 378	24	(36)	(12)	0,00
	01/2023		3 791	€	3 550	0	0	0	0,00
	01/2023		621	HUF	250 652	45	0	45	0,00
	02/2023	IDR	454 705	$	29	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	$	8 544	MXN	175 798	422	0	422	0,00
	03/2023		2 156	IDR	33 746 125	26	0	26	0,00
	03/2023		132	MXN	2 642	2	0	2	0,00
MYI	01/2023	AUD	118 806	$	79 784	0	(804)	(804)	(0,01)
	01/2023	CHF	16		18	0	0	0	0,00
	01/2023	€	117		125	0	0	0	0,00
	01/2023	£	19		22	0	0	0	0,00
	01/2023	SGD	8 009		5 937	0	(35)	(35)	0,00
	01/2023	$	616	€	578	0	0	0	0,00
	01/2023		8 462	£	7 019	0	(17)	(17)	0,00
	01/2023		734	HUF	300 219	64	0	64	0,00
	01/2023		9	SEK	90	0	0	0	0,00
	03/2023		3 032	IDR	47 547 688	42	0	42	0,00
RBC	01/2023	AUD	1 368	$	918	0	(11)	(11)	0,00
	02/2023	$	16 708	NOK	166 705	244	0	244	0,00
	03/2023	MXN	15 816	$	791	0	(11)	(11)	0,00
RYL	01/2023	$	225	HUF	84 651	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	AUD	1 423	$	959	0	(7)	(7)	0,00
	01/2023	CAD	48 977		36 456	308	0	308	0,00
	01/2023	€	1 411 505		1 469 164	0	(37 906)	(37 906)	(0,36)
	01/2023	KRW	380 588		288	0	(14)	(14)	0,00
	02/2023		3 481	IDR	54 794 297	62	0	62	0,00
	03/2023		4 664	PEN	17 985	23	0	23	0,00
	04/2023	ZAR	143 515	$	7 802	0	(563)	(563)	(0,01)
	06/2023	$	7	CLP	6 047	0	0	0	0,00
SOG	01/2023	ZAR	36 919	$	2 081	0	(88)	(88)	0,00
TOR	01/2023	AUD	6 543		4 416	0	(22)	(22)	0,00
	01/2023	CAD	68 214		50 743	397	0	397	0,00
	01/2023	£	366 664		440 836	0	(295)	(295)	0,00
UAG	01/2023	HUF	632 402		1 425	0	(256)	(256)	0,00
	01/2023	$	841	HUF	331 661	41	0	41	0,00
	01/2023	ZAR	163 781	$	9 144	0	(470)	(470)	(0,01)
	02/2023	$	5 126	IDR	81 363 597	136	0	136	0,00
	03/2023	ZAR	146 658	$	8 205	0	(354)	(354)	0,00
	09/2023		185 425		10 576	0	(102)	(102)	0,00
						$ 8 312	$ (60 997)	$ (52 685)	(0,50)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en AUD (couverte) de distribution et Investisseurs en AUD (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$	4 073	AUD	6 047	$ 29	$ 0	$ 29	0,00
CBK	01/2023	AUD	130	$	88	0	0	0	0,00
	01/2023	$	1	AUD	1	0	0	0	0,00
MBC	01/2023		1 577		2 343	14	(2)	12	0,00
MYI	01/2023		3 661		5 451	37	0	37	0,00
UAG	01/2023		2 888		4 278	14	0	14	0,00
						$ 94	$ (2)	$ 92	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CAD (couverte) de distribution et Investisseurs en CAD (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	72	CAD	98	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BOM	01/2023		33		45	0	0	0	0,00
CBK	01/2023		11		14	0	0	0	0,00
MBC	01/2023		82		110	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	CAD	296	$	221	2	0	2	0,00
SCX	01/2023	$	21	CAD	29	0	0	0	0,00
						$ 2	$ 0	$ 2	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de distribution, Investisseurs en CHF (couverte) de capitalisation, Investisseurs en CHF (couverte) de distribution, Administrations en CHF (couverte) de capitalisation, E en CHF (couverte) de capitalisation et W en CHF (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	CHF	508	$	542	$ 0	$ (7)	$ (7)	0,00
	01/2023	$	302 931	CHF	286 434	6 859	0	6 859	0,06
BRC	01/2023		801		743	3	0	3	0,00
CBK	01/2023	CHF	427	$	460	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	$	522 629	CHF	493 801	11 435	0	11 435	0,11
MBC	01/2023	CHF	1 512	$	1 624	1	(12)	(11)	0,00
	01/2023	$	552	CHF	512	2	0	2	0,00
MYI	01/2023	CHF	1 121	$	1 203	0	(10)	(10)	0,00
	01/2023	$	554	CHF	524	12	0	12	0,00
SCX	01/2023	CHF	1 751	$	1 890	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	$	24	CHF	23	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	CHF	119	$	129	0	0	0	0,00
						$ 18 312	$ (36)	$ 18 276	0,17

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CZK (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
CBK	01/2023	$	4 337	CZK	101 869	$ 162	$ 0	$ 162	0,00
GLM	01/2023		4 954		116 425	188	0	188	0,01
MBC	01/2023		4 835		113 831	193	0	193	0,00
MYI	01/2023	CZK	1 787	$	79	0	0	0	0,00
	01/2023	$	530	CZK	12 387	17	0	17	0,00
						$ 560	$ 0	$ 560	0,01

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (exposition au risque de change) de capitalisation, Institutions en USD (exposition au risque de change) de capitalisation, Institutions en USD (exposition au risque de change) de distribution, E en EUR (exposition au risque de change) de distribution et H Institutions en USD (exposition au risque de change) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	787	CAD	1 075	$ 6	$ 0	$ 6	0,00
	01/2023		75	CHF	71	2	0	2	0,00
	01/2023		107	€	101	1	0	1	0,00
	01/2023		3 968	£	3 265	0	(40)	(40)	0,00
	01/2023		311	¥	41 064	0	0	0	0,00
BOM	01/2023		1 515	CAD	2 034	0	(14)	(14)	0,00
BPS	01/2023		19 571	€	18 360	32	0	32	0,00
BRC	01/2023		3 390	£	2 817	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		59	SEK	613	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	€	247	$	263	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	1 119	AUD	1 667	11	0	11	0,00
	01/2023		621	CHF	587	13	0	13	0,00
	01/2023		1 899	€	1 794	17	0	17	0,00
	01/2023		5	SEK	53	0	0	0	0,00
CLY	01/2023		2 359	€	2 217	9	0	9	0,00
JPM	01/2023		7 493	£	6 205	0	(28)	(28)	0,00
MBC	01/2023	€	526	$	555	0	(6)	(6)	0,00
	01/2023	$	429	AUD	638	3	0	3	0,00
	01/2023		514	CAD	694	1	(3)	(2)	0,00
	01/2023		155	CHF	143	0	0	0	0,00
	01/2023		54 914	€	52 269	894	0	894	0,01
	01/2023		679	£	557	0	(9)	(9)	0,00
	01/2023		1 673	¥	225 591	38	0	38	0,00
MYI	01/2023		1 165	AUD	1 735	12	0	12	0,00
	01/2023		402	CAD	544	0	0	0	0,00
	01/2023		182	¥	24 922	7	0	7	0,00
RBC	01/2023		13	AUD	20	0	0	0	0,00
	01/2023		3 446	CAD	4 687	14	0	14	0,00
SCX	01/2023		78	AUD	116	1	0	1	0,00
	01/2023		1 321	CAD	1 774	0	(11)	(11)	0,00
	01/2023		237	CHF	220	0	0	0	0,00
	01/2023		103	NZD	165	1	0	1	0,00
TOR	01/2023		1 838	CAD	2 471	0	(14)	(14)	0,00
	01/2023		12 793	€	12 021	41	0	41	0,00
UAG	01/2023		202	£	164	0	(4)	(4)	0,00
						$ 1 103	$ (131)	$ 972	0,01

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Investisseurs en EUR (couverte) de distribution, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, Administrations en EUR (couverte) de distribution, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution, R en EUR (couverte) de distribution, T en EUR (couverte) de capitalisation, W en EUR (couverte) de capitalisation et W en EUR (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€ 4 583	$ 4 833	$ 0	$ (60)	$ (60)	0,00
BPS	01/2023	$ 2 447	€ 2 294	2	0	2	0,00
CBK	01/2023	€ 73 656	$ 78 366	0	(277)	(277)	0,00
	01/2023	$ 851 063	€ 820 317	24 795	0	24 795	0,23
MBC	01/2023	€ 56 433	$ 59 894	1	(360)	(359)	0,00
	01/2023	$ 1 006 345	€ 960 260	18 931	0	18 931	0,18
SCX	01/2023	917 363	881 359	23 671	0	23 671	0,22
				$ 67 400	$ (697)	$ 66 703	0,63

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution, Investisseurs en GBP (couverte) de distribution, Administrations en GBP (couverte) de distribution, E en GBP (couverte) de distribution, R en GBP (couverte) de distribution, W en GBP (couverte) de capitalisation et W en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 2 620	$ 3 181	$ 29	$ 0	$ 29	0,00
	01/2023	$ 1 724	£ 1 396	0	(45)	(45)	0,00
BPS	01/2023	£ 1 043	$ 1 258	3	0	3	0,00
BRC	01/2023	7 232	8 710	9	0	9	0,00
JPM	01/2023	$ 385 703	£ 319 416	0	(1 418)	(1 418)	(0,01)
MBC	01/2023	£ 21 134	$ 25 780	354	0	354	0,00
	01/2023	$ 385 068	£ 320 881	1 511	(530)	981	0,01
MYI	01/2023	£ 294	$ 362	8	0	8	0,00
	01/2023	$ 1 827	£ 1 497	0	(26)	(26)	0,00
TOR	01/2023	385 452	320 598	258	0	258	0,00
UAG	01/2023	£ 228	$ 280	6	0	6	0,00
	01/2023	$ 2 025	£ 1 636	0	(57)	(57)	0,00
				$ 2 178	$ (2 076)	$ 102	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BRC	01/2023	NOK 186	$ 19	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$ 7 828	NOK 77 890	81	0	81	0,00
CBK	01/2023	8 656	85 800	56	0	56	0,00
MBC	01/2023	NOK 6	$ 1	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 988	NOK 9 676	0	(6)	(6)	0,00
RYL	01/2023	0	3	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	8 832	87 589	65	(3)	62	0,00
				$ 202	$ (9)	$ 193	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SEK (couverte) de capitalisation et Administrations en SEK (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	SEK 459	$ 44	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$ 2 585	SEK 26 617	0	(30)	(30)	0,00
BRC	01/2023	115 076	1 205 229	637	0	637	0,01
CBK	01/2023	SEK 211 595	$ 20 374	59	0	59	0,00
	01/2023	$ 15 335	SEK 159 790	6	0	6	0,00
MBC	01/2023	SEK 3 219	$ 308	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 912	SEK 9 389	0	(11)	(11)	0,00
MYI	01/2023	41 998	441 747	413	0	413	0,01
SCX	01/2023	SEK 321	$ 31	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 354	SEK 3 723	3	0	3	0,00
UAG	01/2023	SEK 163 175	$ 15 879	213	0	213	0,00
	01/2023	$ 202 357	SEK 2 122 776	1 449	0	1 449	0,01
				$ 2 780	$ (42)	$ 2 738	0,03

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de distribution, Investisseurs en SGD (couverte) de distribution, Administrations en SGD (couverte) de distribution, E en SGD (couverte) de distribution et W en SGD (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$ 191	SGD 260	$ 3	$ 0	$ 3	0,00
BOA	01/2023	10 393	14 254	236	0	236	0,00
BPS	01/2023	11 128	15 251	245	0	245	0,01

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BRC	01/2023	$	7 037	SGD	9 493	$ 42	$ 0	$ 42	0,00
GLM	01/2023		599		814	7	0	7	0,00
MBC	01/2023	SGD	340	$	254	0	0	0	0,00
	01/2023	$	10 480	SGD	14 329	205	0	205	0,00
RYL	01/2023		1 114		1 511	14	0	14	0,00
SCX	01/2023		172		233	1	0	1	0,00
UAG	01/2023		764		1 034	7	0	7	0,00
						$ 760	$ 0	$ 760	0,01
Total des Instruments financiers dérivés hors cote								**$ 8 362**	**0,08**

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
2,000 % éch. 01/01/2053	$ 68 300	$ (55 591)	(0,53)
2,000 % éch. 01/02/2053	99 000	(80 664)	(0,76)
Total des Titres vendus à découvert		**$ (136 255)**	**(1,29)**
Total des Investissements		**$ 10 674 546**	**101,29**
Autres actifs et passifs à court terme		**$ (136 205)**	**(1,29)**
Actif net		**$ 10 538 341**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* **Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

^ **Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.**

(a) **Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).**

(b) **Titre à rémunération en nature.**

(c) **Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.**

(d) **Titre à coupon zéro.**

(e) **Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.**

(f) **Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.**

(g) **Affilié au Fonds.**

(h) **Titre convertible conditionnel.**

(i) **Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,84 %) :**

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Citigroup, Inc.	2,572 %	03/06/2031	05/26/2020 - 07/09/2020	$ 25 047	$ 20 032	0,19
Deutsche Bank AG	3,729	14/01/2032	21/01/2021	11 264	8 260	0,08
Morgan Stanley	0,000	02/04/2032	11/02/2020	40 835	26 786	0,25
Oracle Corp.	4,100	25/03/2061	24/03/2021 - 26/03/2021	6 837	4 612	0,04
Oracle Corp.	6,250	09/11/2032	07/11/2022	14 475	15 222	0,14
				$ 98 458	$ 74 912	0,70

(j) **Des titres d'une juste valeur globale de 4 048 $ (31 décembre 2021 : 7 613 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.**

Un montant en numéraire de 0 $ (31 décembre 2021 : 20 $) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 213 307 $ (31 décembre 2021 : 253 176 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 55 028 $ (31 décembre 2021 : 21 890 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 1	$ 9 770 167	$ 8 376	$ 9 778 544
Fonds d'investissement	782 040	256 286	0	1 038 326
Contrats de mise en pension	0	75 423	0	75 423
Instruments financiers dérivés[3]	(44 604)	(36 888)	0	(81 492)
Titres vendus à découvert	0	(136 255)	0	(136 255)
Totaux	**$ 737 437**	**$ 9 928 733**	**$ 8 376**	**$ 10 674 546**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 1	$ 16 258 039	$ 25 151	$ 16 283 191
Fonds d'investissement	1 100 873	0	0	1 100 873
Contrats de mise en pension	0	4 429	0	4 429
Instruments financiers dérivés[3]	(17 710)	(6 413)	0	(24 123)
Titres vendus à découvert	0	(224 962)	0	(224 962)
Totaux	**$ 1 083 164**	**$ 16 031 093**	**$ 25 151**	**$ 17 139 408**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	En % de l'actif net
BRC	3,500 %	08/08/2022	TBD(1)	$ (2 704)	$ (2 721)	(0,03)
JML	(0,250)	23/09/2022	TBD(1)	€ (1 348)	(1 433)	(0,01)
Total des Contrats de prise en pension					**$ (4 154)**	**(0,04)**

(1) Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ 32	$ 0	$ 32	$ (17)	$ 0	$ (17)
BOA	5 200	(5 790)	(590)	(1 494)	1 800	306
BOM	360	(470)	(110)	S/O	S/O	S/O
BPS	(21 024)	20 550	(474)	(348)	0	(348)
BRC	977	0	977	(951)	660	(291)
BSH	(11)	0	(11)	S/O	S/O	S/O
CBK	36 530	(37 360)	(830)	(214)	530	316
CLY	24	0	24	S/O	S/O	S/O
DUB	(3 383)	3 210	(173)	(19)	600	581
FBF	189	(250)	(61)	282	(250)	32
GLM	(8 272)	8 408	136	(7 021)	8 520	1 499
GSC	S/O	S/O	S/O	(57)	80	23
GST	1 037	(1 030)	7	6 699	(6 500)	199
HUS	S/O	S/O	S/O	1 587	(1 410)	177
JLN	(237)	0	(237)	928	0	928
JPM	(9 156)	8 080	(1 076)	19 399	(19 970)	(571)
MBC	20 345	(19 090)	1 255	S/O	S/O	S/O
MYC	(594)	630	36	1 021	(2 605)	(1 584)
MYI	(342)	280	(62)	20 129	(15 200)	4 929
RBC	236	(350)	(114)	(17 333)	9 420	(7 913)
RYL	14	0	14	S/O	S/O	S/O
SAL	(90)	0	(90)	(253)	280	27
SCX	(14 373)	13 840	(533)	14 282	(8 320)	5 962
SOG	(88)	30	(58)	896	(760)	136
SSB	S/O	S/O	S/O	94	0	94
TOR	365	(2 890)	(2 525)	14 353	(8 910)	5 443
UAG	623	0	623	12 251	(8 960)	3 291

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	63,86	70,71
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	28,59	23,22
Autres valeurs mobilières	0,33	0,98
Fonds d'investissement	9,85	6,42
Contrats de mise en pension	0,72	0,03
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,41)	(0,09)
Instruments financiers dérivés compensés	(0,44)	(0,42)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,08	0,37
Titres vendus à découvert	(1,29)	(1,31)
Contrats de prise en pension	(0,04)	(0,04)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Australie	1,72	1,36
Autriche	0,21	0,36
Belgique	0,12	0,29
Bermudes	0,66	0,82
Brésil	0,32	1,15
Canada	2,14	2,05
Îles Caïmans	3,29	4,90
Chili	0,06	0,05
Chine	0,27	1,26
Colombie	S/O	0,03
Chypre	0,09	S/O
Danemark	0,30	0,47
Finlande	0,20	0,18
France	2,51	2,51
Allemagne	1,98	2,64
Guernesey, Îles Anglo-normandes	0,33	0,46
Hong Kong	0,27	0,83
Inde	0,25	0,53
Indonésie	0,17	0,35
Irlande	0,78	0,92
Île de Man	S/O	0,18
Italie	2,62	2,23
Japon	1,59	1,92
Jersey, Îles Anglo-normandes	0,53	0,66
Koweït	S/O	0,14
Luxembourg	2,33	4,05
Île Maurice	0,37	0,33
Mexique	0,18	0,49
Multinationales	0,03	0,12
Pays-Bas	2,56	3,17
Norvège	0,13	0,27
Panama	0,18	0,28
Pérou	1,25	1,34
Qatar	0,10	0,24
Roumanie	0,31	0,26
Russie	0,02	0,43
Arabie saoudite	0,16	0,23
Singapour	0,17	0,40
Slovaquie	0,00	0,00
Slovénie	0,10	S/O
Afrique du Sud	0,95	0,47
Corée du Sud	0,07	0,14
Espagne	0,25	0,90
Supranationales	0,22	0,15
Suède	0,32	0,38
Suisse	2,23	2,51
Thaïlande	0,07	0,05
Turquie	0,04	0,03
Ukraine	0,02	0,05
Émirats arabes unis	0,08	0,20
Royaume-Uni	5,72	7,19
États-Unis	51,20	44,58
Uruguay	S/O	0,01
Îles Vierges britanniques	0,40	0,31
Instruments à court terme	2,91	0,04
Fonds d'investissement	9,85	6,42
Contrats de mise en pension	0,72	0,03
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,41)	(0,09)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,07)	0,01
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,01	0,02
Swaps de taux d'intérêt	(0,38)	(0,45)

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,45	0,10
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,81)	(0,19)
Options sur titres	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,03	0,08
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,05	0,08
Contrats de change à terme	(0,50)	(0,28)
Contrats de change à terme couverts	0,86	0,58
Titres vendus à découvert	(1,29)	(1,31)
Autres actifs et passifs à court terme	(1,29)	0,09
Actif net	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
AUSTRALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Boral Finance Pty. Ltd.				
3,750 % éch. 01/05/2028	$	52	$ 46	0,00
Commonwealth Bank of Australia				
3,743 % éch. 12/09/2039 (g)		200	147	0,01
GPT Wholesale Office Fund				
3,222 % éch. 05/11/2031	AUD	1 440	758	0,06
Lendlease Finance Ltd.				
3,400 % éch. 27/10/2027		1 370	811	0,06
Macquarie University				
2,250 % éch. 22/05/2030		750	404	0,03
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.				
3,375 % éch. 30/04/2025	$	150	142	0,01
Transurban Finance Co. Pty. Ltd.				
2,450 % éch. 16/03/2031		2 100	1 657	0,12
Vicinity Centres Trust				
4,927 % éch. 02/06/2028	AUD	2 500	1 638	0,12
Total Australie			5 603	0,41
AUTRICHE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Erste Group Bank AG				
0,125 % éch. 17/05/2028	€	1 400	1 211	0,09
4,250 % éch. 15/10/2027 (f)(g)		1 800	1 528	0,11
6,500 % éch. 15/04/2024 (f)(g)		200	209	0,02
Total Autriche			2 948	0,22
BELGIQUE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
KBC Group NV				
1,500 % éch. 29/03/2026		500	503	0,04
3,000 % éch. 25/08/2030		2 900	2 847	0,21
Silfin NV				
2,875 % éch. 11/04/2027		2 000	1 815	0,13
			5 165	0,38
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Communauté Française de Belgique				
0,625 % éch. 11/06/2035		2 000	1 482	0,11
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap				
1,500 % éch. 11/04/2044		300	220	0,01
3,250 % éch. 12/01/2043		2 100	2 080	0,15
			3 782	0,27
Total Belgique			8 947	0,65
BRÉSIL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Itau Unibanco Holding S.A.				
2,900 % éch. 24/01/2023	$	300	300	0,02
CANADA				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Bank of Montreal				
1,758 % éch. 10/03/2026	CAD	2 900	1 941	0,14
Brookfield Finance, Inc.				
2,724 % éch. 15/04/2031	$	4 850	3 902	0,28
CGI, Inc.				
2,300 % éch. 14/09/2031		1 000	762	0,06
Manulife Financial Corp.				
3,703 % éch. 16/03/2032		1 000	894	0,07
Open Text Corp.				
6,900 % éch. 01/12/2027		2 900	2 904	0,21
Toronto-Dominion Bank				
1,952 % éch. 08/04/2030	€	3 700	3 415	0,25
TransAlta Corp.				
7,750 % éch. 15/11/2029	$	1 350	1 381	0,10
			15 199	1,11
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement canadien				
2,250 % éch. 01/12/2029	CAD	12 200	8 450	0,62
Province du Québec				
1,850 % éch. 13/02/2027	CAD	500	$ 341	0,02
			8 791	0,64
Total Canada			23 990	1,75
ÎLES CAÏMANS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Alibaba Group Holding Ltd.				
2,700 % éch. 09/02/2041	$	2 100	1 346	0,10
Health & Happiness H&H International Holdings Ltd.				
5,625 % éch. 24/10/2024		1 200	1 067	0,08
MAF Sukuk Ltd.				
3,933 % éch. 28/02/2030		400	373	0,03
Xiaomi Best Time International Ltd.				
4,100 % éch. 14/07/2051		1 500	873	0,06
Total Îles Caïmans			3 659	0,27
CHILI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco de Credito e Inversiones S.A.				
2,875 % éch. 14/10/2031		3 100	2 583	0,19
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement chilien				
1,250 % éch. 22/01/2051	€	2 200	1 268	0,09
3,500 % éch. 25/01/2050	$	300	218	0,02
3,500 % éch. 15/04/2053		1 600	1 141	0,08
4,340 % éch. 07/03/2042		1 000	849	0,06
			3 476	0,25
Total Chili			6 059	0,44
COLOMBIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Bancolombia S.A.				
3,000 % éch. 29/01/2025		1 300	1 234	0,09
CHYPRE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Atrium Finance PLC				
2,625 % éch. 05/09/2027	€	1 500	1 122	0,08
DANEMARK				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
A.P. Moller - Maersk A/S				
0,750 % éch. 25/11/2031		1 900	1 519	0,11
GN Store Nord A/S				
0,875 % éch. 25/11/2024		700	673	0,05
Nykredit Realkredit A/S				
1,375 % éch. 12/07/2027		1 650	1 567	0,12
Orsted A/S				
5,125 % éch. 13/09/2034	£	1 300	1 544	0,11
TDC Net A/S				
5,056 % éch. 31/05/2028	€	5 200	5 466	0,40
Total Danemark			10 769	0,79
FINLANDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Balder Finland Oyj				
1,000 % éch. 20/01/2029		400	286	0,02
Kemira Oyj				
1,000 % éch. 30/03/2028		1 000	876	0,06
Nordea Bank Abp				
1,500 % éch. 30/09/2026	$	3 000	2 594	0,19
3,750 % éch. 01/03/2029 (f)(g)		3 300	2 556	0,19
SATO Oyj				
1,375 % éch. 24/02/2028	€	1 200	930	0,07
SBB Treasury Oyj				
1,125 % éch. 26/11/2029		2 100	1 436	0,10
Total Finlande			8 678	0,63
FRANCE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Accor S.A.				
2,375 % éch. 29/11/2028	€	3 100	$ 2 838	0,21
Altarea S.C.A.				
1,875 % éch. 17/01/2028		1 400	1 163	0,08
Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.				
0,250 % éch. 29/06/2028		900	799	0,06
1,750 % éch. 19/12/2024	£	100	113	0,01
4,000 % éch. 21/11/2029	€	2 000	2 141	0,16
BNP Paribas S.A.				
1,675 % éch. 30/06/2027	$	6 150	5 360	0,39
2,219 % éch. 09/06/2026		1 200	1 103	0,08
3,132 % éch. 20/01/2033		2 800	2 218	0,16
3,500 % éch. 16/11/2027		1 800	1 657	0,12
4,625 % éch. 25/02/2031 (f)(g)		2 100	1 628	0,12
6,875 % éch. 06/12/2029 (f)(g)	€	1 000	1 058	0,08
BPCE S.A.				
2,045 % éch. 19/10/2027	$	4 000	3 453	0,25
3,116 % éch. 19/10/2032		300	220	0,02
CNP Assurances				
1,250 % éch. 27/01/2029	€	1 600	1 380	0,10
Credit Agricole Assurances S.A.				
1,500 % éch. 06/10/2031		3 400	2 670	0,19
Crédit Agricole S.A.				
0,125 % éch. 09/12/2027		700	620	0,05
5,803 % éch. 22/03/2024	$	2 000	2 005	0,15
Faurecia SE				
2,750 % éch. 15/02/2027	€	4 000	3 618	0,26
Holding d'Infrastructures des Métiers de l'Environnement				
0,125 % éch. 16/09/2025		3 500	3 302	0,24
Île-de-France Mobilités				
0,675 % éch. 24/11/2036		1 900	1 364	0,10
JCDecaux SE				
1,625 % éch. 07/02/2030		2 300	1 966	0,14
L'Oréal S.A.				
0,875 % éch. 29/06/2026		2 300	2 285	0,17
New Immo Holding S.A.				
2,750 % éch. 26/11/2026		200	182	0,01
Société Générale S.A.				
0,500 % éch. 12/06/2029		400	343	0,03
3,625 % éch. 01/03/2041	$	350	228	0,02
4,000 % éch. 12/01/2027		2 200	2 040	0,15
7,875 % éch. 18/12/2023 (f)(g)		200	198	0,01
Suez SACA				
4,625 % éch. 03/11/2028	€	300	324	0,02
5,000 % éch. 03/11/2032		1 200	1 315	0,10
Valeo				
1,000 % éch. 03/08/2028		2 900	2 390	0,17
5,375 % éch. 28/05/2027		1 800	1 875	0,14
Verallia S.A.				
1,625 % éch. 14/05/2028		1 400	1 291	0,09
Vilmorin & Cie S.A.				
1,375 % éch. 26/03/2028		1 400	1 108	0,08
			54 255	3,96
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Action Logement Services				
1,375 % éch. 13/04/2032		2 500	2 216	0,16
Agence Française de Développement				
1,625 % éch. 25/05/2032		2 000	1 813	0,13
Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale				
1,375 % éch. 20/01/2031	$	4 000	3 227	0,24
2,750 % éch. 25/11/2032	€	1 000	1 008	0,07
Obligation internationale du gouvernement français				
0,500 % éch. 25/06/2044		2 100	1 295	0,09
SNCF Réseau				
0,750 % éch. 25/05/2036		500	369	0,03
Société Nationale SNCF S.A.				
3,125 % éch. 02/11/2027		5 600	5 883	0,43
UNEDIC ASSEO				
0,000 % éch. 19/11/2030 (c)		300	249	0,02
0,250 % éch. 16/07/2035		500	357	0,03
			16 417	1,20
Total France			70 672	5,16

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ALLEMAGNE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Amprion GmbH					
3,450 % éch. 22/09/2027	€	1 500	$	1 573	0,11
Deutsche Bahn Finance GmbH					
0,625 % éch. 08/12/2050		750		399	0,03
Deutsche Bank AG					
1,447 % éch. 01/04/2025 (h)	$	2 000		1 858	0,13
1,875 % éch. 23/02/2028	€	2 500		2 338	0,17
2,222 % éch. 18/09/2024	$	100		97	0,01
2,311 % éch. 16/11/2027		3 000		2 547	0,19
3,547 % éch. 18/09/2031		300		241	0,02
3,742 % éch. 07/01/2033		2 300		1 638	0,12
3,961 % éch. 26/11/2025		500		478	0,03
Eurogrid GmbH					
1,113 % éch. 15/05/2032	€	300		253	0,02
3,279 % éch. 05/09/2031		1 000		1 026	0,07
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau					
0,750 % éch. 30/09/2030	$	1 100		862	0,06
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen					
1,000 % éch. 26/05/2042	€	900		676	0,05
Schaeffler AG					
3,375 % éch. 12/10/2028		3 200		2 983	0,22
Sixt SE					
1,750 % éch. 09/12/2024		400		412	0,03
Vantage Towers AG					
0,000 % éch. 31/03/2025 (c)		500		512	0,04
0,375 % éch. 31/03/2027		400		399	0,03
Vonovia SE					
0,250 % éch. 01/09/2028		1 600		1 310	0,10
1,375 % éch. 28/01/2026		2 600		2 521	0,18
1,875 % éch. 28/06/2028		1 900		1 730	0,13
2,375 % éch. 25/03/2032		400		341	0,02
ZF Finance GmbH					
2,000 % éch. 06/05/2027		1 500		1 315	0,10
2,250 % éch. 03/05/2028		2 300		1 926	0,14
				27 435	2,00
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
République d'Allemagne					
0,000 % éch. 15/08/2031 (c)		14 700		12 671	0,93
État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie					
0,500 % éch. 25/11/2039		200		137	0,01
				12 808	0,94
Total Allemagne				40 243	2,94
GUERNESEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Globalworth Real Estate Investments Ltd.					
2,950 % éch. 29/07/2026		2 100		1 785	0,13
Sirius Real Estate Ltd.					
1,125 % éch. 22/06/2026		1 100		919	0,07
1,750 % éch. 24/11/2028		2 300		1 689	0,12
Total Guernesey, Îles Anglo-normandes				4 393	0,32
HONG KONG					
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement de Hong Kong					
2,375 % éch. 02/02/2051	$	300		189	0,01
INDE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Bharti Airtel Ltd.					
3,250 % éch. 03/06/2031		500		423	0,03
4,375 % éch. 10/06/2025		1 200		1 167	0,09
Indian Railway Finance Corp. Ltd.					
3,570 % éch. 21/01/2032		5 100		4 389	0,32
JSW Hydro Energy Ltd.					
4,125 % éch. 18/05/2031		3 806		3 177	0,23
ReNew Power Pvt Ltd.					
5,875 % éch. 05/03/2027		1 550		1 490	0,11
ReNew Wind Energy AP2					
4,500 % éch. 14/07/2028		3 000		2 521	0,18
Total Inde				13 167	0,96

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
IRLANDE					
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS					
Jubilee CLO DAC					
2,128 % éch. 12/07/2028	€	8	$	8	0,00
OCP Euro CLO DAC					
0,000 % éch. 20/01/2033 (b)		2 000		2 124	0,16
				2 132	0,16
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
AIB Group PLC					
2,250 % éch. 04/04/2028		2 800		2 671	0,20
5,750 % éch. 16/02/2029		2 000		2 189	0,16
6,250 % éch. 23/06/2025 (f)(g)		300		301	0,02
Bank of Ireland Group PLC					
1,875 % éch. 05/06/2026		2 900		2 876	0,21
6,253 % éch. 16/09/2026	$	3 500		3 474	0,25
7,594 % éch. 06/12/2032	£	3 000		3 590	0,26
CCEP Finance Ireland DAC					
0,500 % éch. 06/09/2029	€	1 900		1 647	0,12
Smurfit Kappa Acquisitions ULC					
2,875 % éch. 15/01/2026		300		311	0,02
				17 059	1,24
Total Irlande				19 191	1,40
ITALIE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Intesa Sanpaolo SpA					
2,625 % éch. 11/03/2036	£	1 000		773	0,06
3,875 % éch. 12/01/2028	$	1 400		1 236	0,09
4,198 % éch. 01/06/2032		900		663	0,05
4,950 % éch. 01/06/2042		1 600		1 032	0,08
5,017 % éch. 26/06/2024		3 900		3 751	0,27
Nexi SpA					
2,125 % éch. 30/04/2029	€	1 600		1 390	0,10
Snam SpA					
0,750 % éch. 20/06/2029		500		436	0,03
UniCredit SpA					
1,982 % éch. 03/06/2027	$	1 900		1 622	0,12
4,625 % éch. 12/04/2027		2 000		1 875	0,14
5,459 % éch. 30/06/2035		1 300		1 059	0,08
5,850 % éch. 15/11/2027	€	300		325	0,02
7,296 % éch. 02/04/2034	$	4 400		4 041	0,29
Total Italie				18 203	1,33
JAPON					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.					
0,337 % éch. 08/06/2027	€	700		654	0,05
0,339 % éch. 19/07/2024		200		204	0,01
0,980 % éch. 09/10/2023		300		316	0,02
1,538 % éch. 20/07/2027	$	2 400		2 084	0,15
2,494 % éch. 13/10/2032		2 900		2 267	0,17
2,757 % éch. 13/09/2026		3 932		3 598	0,26
3,273 % éch. 19/09/2025	€	2 000		2 102	0,15
3,837 % éch. 17/04/2026	$	1 400		1 350	0,10
Mitsui Fudosan Co. Ltd.					
2,950 % éch. 23/01/2023		3 385		3 381	0,25
Mizuho Financial Group, Inc.					
0,214 % éch. 07/10/2025	€	100		98	0,01
2,201 % éch. 10/07/2031	$	2 900		2 270	0,17
2,839 % éch. 13/09/2026		8 261		7 528	0,55
3,261 % éch. 22/05/2030		4 800		4 162	0,30
3,490 % éch. 05/09/2027	€	1 700		1 768	0,13
Nippon Life Insurance Co.					
2,900 % éch. 16/09/2051	$	700		562	0,04
Nomura Holdings, Inc.					
2,172 % éch. 14/07/2028		4 100		3 392	0,25
2,329 % éch. 22/01/2027		3 900		3 420	0,25
Norinchukin Bank					
1,284 % éch. 22/09/2026		2 000		1 745	0,13
NTT Finance Corp.					
4,142 % éch. 26/07/2024		2 700		2 659	0,19
ORIX Corp.					
1,919 % éch. 20/04/2026	€	3 000		3 011	0,22
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.					
2,472 % éch. 14/01/2029	$	3 900		3 292	0,24

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
3,010 % éch. 19/10/2026	$	1 395	$	1 290	0,09
3,202 % éch. 17/09/2029 (g)		400		344	0,03
5,087 % éch. 19/07/2023		100		100	0,01
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.					
2,800 % éch. 10/03/2027		1 200		1 093	0,08
Total Japon				52 690	3,85
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
AA Bond Co. Ltd.					
4,875 % éch. 31/07/2043	£	100		114	0,01
Aptiv PLC					
3,100 % éch. 01/12/2051	$	1 800		1 071	0,08
Total Jersey, Îles Anglo-normandes				1 185	0,09
LUXEMBOURG					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Acef Holding S.C.A.					
0,750 % éch. 14/06/2028	€	1 700		1 342	0,10
1,250 % éch. 26/04/2030		2 900		2 138	0,16
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund					
0,500 % éch. 27/01/2028		600		496	0,04
0,900 % éch. 12/10/2029		3 700		2 885	0,21
CPI Property Group S.A.					
1,500 % éch. 27/01/2031		500		310	0,02
1,750 % éch. 14/01/2030		3 300		2 149	0,16
2,750 % éch. 12/05/2026		200		168	0,01
2,750 % éch. 22/01/2028	£	350		282	0,02
Logicor Financing SARL					
1,625 % éch. 17/01/2030	€	500		390	0,03
2,000 % éch. 17/01/2034		2 900		1 970	0,14
Prologis International Funding S.A.					
2,750 % éch. 22/02/2032	£	600		580	0,04
Segro Capital SARL					
1,875 % éch. 23/03/2030	€	550		501	0,04
SELP Finance SARL					
0,875 % éch. 27/05/2029		2 200		1 776	0,13
SIG Combibloc Purchase Co. SARL					
1,875 % éch. 18/06/2023		300		318	0,02
				15 305	1,12
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
État du Grand-Duché de Luxembourg					
0,000 % éch. 14/09/2032 (c)		2 000		1 594	0,11
Total Luxembourg				16 899	1,23
ÎLE MAURICE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
India Green Energy Holdings					
5,375 % éch. 29/04/2024	$	1 450		1 396	0,10
India Green Power Holdings					
4,000 % éch. 22/02/2027		1 200		1 028	0,08
Total Île Maurice				2 424	0,18
MEXIQUE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Banco Mercantil del Norte S.A.					
6,625 % éch. 24/01/2032 (f)(g)		1 800		1 494	0,11
Cibanco S.A. Ibm					
4,962 % éch. 18/07/2029		700		639	0,04
Metalsa S.A. de C.V.					
3,750 % éch. 04/05/2031		2 900		2 286	0,17
Total Mexique				4 419	0,32
MULTINATIONALES					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC					
3,000 % éch. 01/09/2029	€	350		275	0,02
NXP BV					
2,500 % éch. 11/05/2031	$	2 660		2 125	0,16
5,000 % éch. 15/01/2033		6 500		6 158	0,45
Total Multinational				8 558	0,63

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
PAYS-BAS			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
ABN AMRO Bank NV			
2,470 % éch. 13/12/2029	$ 6 800	$ 5 511	0,40
Akzo Nobel NV			
2,000 % éch. 28/03/2032	€ 750	681	0,05
Alcoa Nederland Holding BV			
5,500 % éch. 15/12/2027	$ 1 000	965	0,07
Citycon Treasury BV			
1,625 % éch. 12/03/2028	€ 400	312	0,02
Compass Group Finance Netherlands BV			
3,000 % éch. 08/03/2030	1 700	1 724	0,13
Cooperatieve Rabobank UA			
1,004 % éch. 24/09/2026	$ 3 500	3 095	0,23
1,106 % éch. 24/02/2027	800	700	0,05
3,100 % éch. 29/06/2028 (f)(g)	€ 1 000	828	0,06
3,758 % éch. 06/04/2033	$ 3 450	2 948	0,22
4,375 % éch. 29/06/2027 (f)(g)	€ 1 000	953	0,07
4,875 % éch. 29/06/2029 (f)(g)	2 800	2 571	0,19
5,250 % éch. 14/09/2027	£ 800	930	0,07
CTP NV			
0,500 % éch. 21/06/2025	€ 3 000	2 688	0,20
0,875 % éch. 20/01/2026	2 700	2 349	0,17
1,250 % éch. 21/06/2029	400	285	0,02
1,500 % éch. 27/09/2031	2 500	1 604	0,12
Digital Dutch Finco BV			
1,000 % éch. 15/01/2032	350	263	0,02
1,250 % éch. 01/02/2031	1 100	862	0,06
Digital Intrepid Holding BV			
0,625 % éch. 15/07/2031	1 650	1 212	0,09
1,375 % éch. 18/07/2032	1 000	763	0,06
EnBW International Finance BV			
3,625 % éch. 22/11/2026	2 050	2 193	0,16
Enel Finance International NV			
0,375 % éch. 28/05/2029	2 000	1 699	0,12
1,875 % éch. 12/07/2028	$ 1 700	1 353	0,10
2,250 % éch. 12/07/2031	2 300	1 679	0,12
2,875 % éch. 11/04/2029	£ 3 100	3 197	0,23
4,625 % éch. 15/06/2027	$ 5 400	5 117	0,37
7,750 % éch. 14/10/2052	2 000	2 147	0,16
Holcim Sterling Finance Netherlands BV			
2,250 % éch. 04/04/2034	£ 1 800	1 487	0,11
Iberdrola International BV			
6,750 % éch. 15/09/2033	$ 1 200	1 269	0,09
ING Groep NV			
1,400 % éch. 01/07/2026	1 800	1 620	0,12
1,726 % éch. 01/04/2027	1 900	1 679	0,12
2,125 % éch. 23/05/2026	€ 2 700	2 746	0,20
3,875 % éch. 16/05/2027 (f)(g)	$ 200	147	0,01
4,017 % éch. 28/03/2028	2 300	2 154	0,16
4,125 % éch. 24/08/2033	€ 2 100	2 114	0,15
4,250 % éch. 16/05/2031 (f)(g)	$ 1 000	689	0,05
4,875 % éch. 16/05/2029 (f)(g)	600	465	0,03
5,750 % éch. 16/11/2026 (f)(g)	550	488	0,04
6,500 % éch. 16/04/2025 (f)(g)	300	284	0,02
JAB Holdings BV			
4,500 % éch. 08/04/2052	4 100	2 797	0,20
JDE Peet's NV			
0,625 % éch. 09/02/2028	€ 1 300	1 163	0,09
1,125 % éch. 16/06/2033	300	233	0,02
2,250 % éch. 24/09/2031	$ 1 000	758	0,06
LeasePlan Corp. NV			
0,250 % éch. 07/09/2026	€ 3 500	3 205	0,23
1,375 % éch. 07/03/2024	800	830	0,06
Mondelez International Holdings Netherlands BV			
0,250 % éch. 09/09/2029	2 000	1 709	0,13
Nationale-Nederlanden Bank NV			
0,500 % éch. 21/09/2028	2 800	2 426	0,18
1,875 % éch. 17/05/2032	500	474	0,03
NE Property BV			
2,000 % éch. 20/01/2030	4 200	3 112	0,23
3,375 % éch. 14/07/2027	600	556	0,04
Prosus NV			
2,085 % éch. 19/01/2030	1 300	1 084	0,08
2,778 % éch. 19/01/2034	200	154	0,01
3,257 % éch. 19/01/2027	$ 2 200	1 970	0,14
SGS Nederland Holding BV			
0,125 % éch. 21/04/2027	€ 1 900	1 938	0,14
Stedin Holding NV			
0,500 % éch. 14/11/2029	€ 100	$ 86	0,01
TenneT Holding BV			
4,250 % éch. 28/04/2032	1 000	1 092	0,08
Thermo Fisher Scientific Finance BV			
0,000 % éch. 18/11/2025 (c)	1 000	968	0,07
2,000 % éch. 18/10/2051	1 700	1 148	0,08
Vesteda Finance BV			
0,750 % éch. 18/10/2031	3 700	2 876	0,21
Vonovia Finance BV			
1,125 % éch. 08/09/2025	200	195	0,01
Wabtec Transportation Netherlands BV			
1,250 % éch. 03/12/2027	4 200	3 811	0,28
WPC Eurobond BV			
1,350 % éch. 15/04/2028	200	178	0,01
		96 534	7,05
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES			
Green Storm BV			
2,571 % éch. 22/02/2068	200	215	0,02
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
BNG Bank NV			
0,050 % éch. 20/11/2029	100	86	0,01
0,500 % éch. 26/11/2025	500	496	0,03
Nederlandse Waterschapsbank NV			
0,125 % éch. 03/09/2035	1 900	1 370	0,10
		1 952	0,14
Total Pays-Bas		98 701	7,21
NORVÈGE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
DNB Bank ASA			
0,375 % éch. 18/01/2028	2 400	2 234	0,16
PÉROU			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement péruvien			
1,950 % éch. 17/11/2036	2 000	1 476	0,11
ROUMANIE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement roumain			
1,750 % éch. 13/07/2030	2 100	1 566	0,11
2,625 % éch. 02/12/2040	2 900	1 734	0,13
3,750 % éch. 07/02/2034	900	719	0,05
Total Roumanie		4 019	0,29
SERBIE			
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement serbe			
1,000 % éch. 23/09/2028	2 000	1 540	0,11
1,650 % éch. 03/03/2033	400	260	0,02
Total Serbie		1 800	0,13
SINGAPOUR			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Clean Renewable Power Mauritius Pte. Ltd.			
4,250 % éch. 25/03/2027	$ 1 242	1 079	0,08
United Overseas Bank Ltd.			
3,863 % éch. 07/10/2032 (g)	4 000	3 692	0,27
Total Singapour		4 771	0,35
AFRIQUE DU SUD			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Growthpoint Properties International Pty. Ltd.			
5,872 % éch. 02/05/2023	300	299	0,02
CORÉE DU SUD			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
KB Kookmin Card Co. Ltd.			
1,500 % éch. 13/05/2026	2 600	2 254	0,16
Kookmin Bank			
2,500 % éch. 04/11/2030 (g)	$ 900	$ 718	0,05
Shinhan Bank Co. Ltd.			
1,183 % éch. 29/09/2025	AUD 800	485	0,04
4,000 % éch. 23/04/2029 (g)	$ 600	536	0,04
4,375 % éch. 13/04/2032 (g)	2 200	1 966	0,14
5,000 % éch. 16/11/2025	AUD 1 500	1 028	0,08
SK Hynix, Inc.			
2,375 % éch. 19/01/2031	$ 1 000	734	0,05
		7 721	0,56
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Export-Import Bank of Korea			
2,125 % éch. 18/01/2032	2 000	1 602	0,12
Korea Expressway Corp.			
1,125 % éch. 17/05/2026	1 000	888	0,06
Korea Housing Finance Corp.			
0,010 % éch. 05/02/2025	€ 400	396	0,03
Korea Water Resources Corp.			
3,500 % éch. 27/04/2025	$ 3 500	3 378	0,25
		6 264	0,46
Total Corée du Sud		13 985	1,02
ESPAGNE			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banco de Sabadell S.A.			
0,875 % éch. 16/06/2028	€ 3 400	2 927	0,21
5,125 % éch. 10/11/2028	2 500	2 678	0,20
Banco Santander S.A.			
0,625 % éch. 24/06/2029	800	702	0,05
3,490 % éch. 28/05/2030	$ 400	338	0,02
3,625 % éch. 21/03/2029 (f)(g)	€ 600	446	0,03
4,125 % éch. 12/11/2027 (f)(g)	1 000	856	0,06
4,175 % éch. 24/03/2028	$ 2 000	1 858	0,14
4,375 % éch. 14/01/2026 (f)(g)	€ 400	364	0,03
Bankinter S.A.			
0,625 % éch. 06/10/2027	1 000	901	0,07
CaixaBank S.A.			
0,625 % éch. 21/01/2028	3 000	2 785	0,20
1,500 % éch. 03/12/2026	£ 700	736	0,05
5,375 % éch. 14/11/2030	€ 100	109	0,01
5,875 % éch. 09/10/2027 (f)(g)	800	784	0,06
Cellnex Finance Co. S.A.			
3,875 % éch. 07/07/2041	$ 1 000	686	0,05
		16 170	1,18
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Obligation internationale du gouvernement espagnol			
1,000 % éch. 30/07/2042	€ 3 170	2 059	0,15
Xunta de Galicia			
0,084 % éch. 30/07/2027	150	138	0,01
		2 197	0,16
Total Espagne		18 367	1,34
SUPRANATIONALES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Banque de développement asiatique			
1,500 % éch. 04/05/2028	CAD 2 000	1 314	0,09
6,550 % éch. 26/01/2025	ZAR 64 000	3 666	0,27
Banque Ouest Africaine de Développement			
2,750 % éch. 22/01/2033	€ 800	649	0,05
Eurofima Europaeische Gesellschaft fuer die Finanzierung von Eisenbahnmaterial			
0,000 % éch. 28/07/2026 (c)	1 000	952	0,07
3,125 % éch. 09/11/2031	3 200	3 384	0,25
Banque européenne d'investissement			
0,750 % éch. 15/07/2027	AUD 2 100	1 214	0,09
1,500 % éch. 15/06/2032	€ 3 000	2 787	0,20
Union européenne			
0,000 % éch. 04/10/2030 (c)	3 700	3 134	0,23
0,000 % éch. 04/07/2035 (c)	700	504	0,04
0,300 % éch. 04/11/2050	1 900	970	0,07
0,400 % éch. 04/02/2037	2 150	1 557	0,11
1,250 % éch. 04/02/2043	8 000	6 016	0,44
2,625 % éch. 04/02/2048	1 300	1 255	0,09

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
2,750 % éch. 04/02/2033	€	2 370	$ 2 435	0,18
2,750 % éch. 04/12/2037		10 000	9 936	0,72
Total Supranational			39 773	2,90
SUÈDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
EQT AB				
0,875 % éch. 14/05/2031		3 200	2 373	0,17
2,375 % éch. 06/04/2028		1 000	940	0,07
2,875 % éch. 06/04/2032		3 000	2 597	0,19
Skandinaviska Enskilda Banken AB				
4,000 % éch. 09/11/2026		1 500	1 607	0,12
Volvo Car AB				
2,500 % éch. 07/10/2027		1 400	1 322	0,10
			8 839	0,65
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement suédois				
0,125 % éch. 09/09/2030	SEK	9 000	733	0,05
Total Suède			9 572	0,70
SUISSE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
UBS Group AG				
4,125 % éch. 24/09/2025	$	4 300	4 185	0,31
4,125 % éch. 15/04/2026		3 602	3 460	0,25
4,375 % éch. 10/02/2031 (f)(g)		1 200	915	0,07
Total Suisse			8 560	0,63
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Anglian Water Services Financing PLC				
2,750 % éch. 26/10/2029	£	100	104	0,01
Assura Financing PLC				
1,625 % éch. 30/06/2033		1 200	965	0,07
Atlantica Sustainable Infrastructure PLC				
4,125 % éch. 15/06/2028	$	1 400	1 244	0,09
Barclays PLC				
2,667 % éch. 10/03/2032		1 000	765	0,05
2,894 % éch. 24/11/2032		300	229	0,02
5,501 % éch. 09/08/2028		300	291	0,02
5,746 % éch. 09/08/2033		1 737	1 646	0,12
7,250 % éch. 15/03/2023 (f)(g)	£	1 200	1 430	0,10
7,750 % éch. 15/09/2023 (f)(g)	$	2 100	2 055	0,15
Berkeley Group PLC				
2,500 % éch. 11/08/2031	£	3 250	2 624	0,19
Brookfield Finance UK PLC				
2,340 % éch. 30/01/2032	$	3 000	2 291	0,17
Burberry Group PLC				
1,125 % éch. 21/09/2025	£	500	536	0,04
Chanel Ceres PLC				
0,500 % éch. 31/07/2026	€	800	770	0,06
1,000 % éch. 31/07/2031		2 600	2 143	0,16
Clarion Funding PLC				
1,250 % éch. 13/11/2032	£	700	582	0,04
1,875 % éch. 22/01/2035		200	164	0,01
CSL Finance PLC				
4,250 % éch. 27/04/2032	$	1 100	1 039	0,08
Derwent London PLC				
1,875 % éch. 17/11/2031	£	2 200	1 870	0,14
Direct Line Insurance Group PLC				
4,000 % éch. 05/06/2032		300	284	0,02
Ferguson Finance PLC				
3,250 % éch. 02/06/2030	$	300	255	0,02
Grainger PLC				
3,000 % éch. 03/07/2030	£	1 260	1 139	0,08
HSBC Holdings PLC				
1,750 % éch. 24/07/2027		2 700	2 796	0,20
2,013 % éch. 22/09/2028	$	900	754	0,05
2,804 % éch. 24/05/2032		1 200	931	0,07
2,871 % éch. 22/11/2032		1 300	997	0,07
2,999 % éch. 10/03/2026		2 900	2 728	0,20
3,000 % éch. 22/07/2028	£	100	105	0,01
3,973 % éch. 22/05/2030	$	2 600	2 281	0,17
4,041 % éch. 13/03/2028		200	185	0,01
4,600 % éch. 17/12/2030 (f)(g)		800	624	0,04
5,402 % éch. 11/08/2033	$	1 200	$ 1 115	0,08
6,000 % éch. 29/09/2023 (f)(g)	€	200	211	0,01
7,336 % éch. 03/11/2026	$	1 200	1 249	0,09
Informa PLC				
1,500 % éch. 05/07/2023	€	237	251	0,02
InterContinental Hotels Group PLC				
3,375 % éch. 08/10/2028	£	1 400	1 459	0,11
John Lewis PLC				
4,250 % éch. 18/12/2034		300	220	0,02
6,125 % éch. 21/01/2025		100	116	0,01
Lendlease Europe Finance PLC				
3,500 % éch. 02/12/2033		3 300	2 552	0,19
Lloyds Banking Group PLC				
3,574 % éch. 07/11/2028	$	1 900	1 712	0,12
3,750 % éch. 18/03/2028		1 600	1 479	0,11
London & Quadrant Housing Trust				
2,000 % éch. 31/03/2032	£	1 400	1 275	0,09
LSEGA Financing PLC				
3,200 % éch. 06/04/2041	$	1 000	730	0,05
Marks & Spencer PLC				
3,750 % éch. 19/05/2026	£	1 000	1 051	0,08
4,500 % éch. 10/07/2027		300	311	0,02
Motability Operations Group PLC				
1,500 % éch. 20/01/2041		400	288	0,02
National Grid Electricity Transmission PLC				
0,190 % éch. 20/01/2025	€	300	299	0,02
Nationwide Building Society				
4,302 % éch. 08/03/2029	$	900	814	0,06
NatWest Group PLC				
0,780 % éch. 26/02/2030	€	500	420	0,03
1,642 % éch. 14/06/2027	$	900	780	0,06
2,057 % éch. 09/11/2028	£	1 900	1 908	0,14
4,269 % éch. 22/03/2025	$	1 500	1 468	0,11
5,125 % éch. 12/05/2027 (f)(g)	£	400	405	0,03
7,472 % éch. 10/11/2026	$	3 800	3 958	0,29
Peabody Capital PLC				
2,750 % éch. 02/03/2034	£	500	470	0,03
Pearson Funding PLC				
3,750 % éch. 04/06/2030		500	533	0,04
Places for People Treasury PLC				
2,500 % éch. 26/01/2036		2 200	1 845	0,13
Santander UK Group Holdings PLC				
3,373 % éch. 05/01/2024	$	1 400	1 400	0,10
3,823 % éch. 03/11/2028		2 100	1 880	0,14
4,750 % éch. 15/09/2025		600	572	0,04
6,833 % éch. 21/11/2026		1 500	1 521	0,11
Severn Trent Utilities Finance PLC				
2,000 % éch. 02/06/2040	£	300	227	0,02
2,625 % éch. 22/02/2033		1 800	1 730	0,13
SSE PLC				
1,750 % éch. 16/04/2030	€	100	91	0,01
2,875 % éch. 01/08/2029		300	300	0,02
Standard Chartered PLC				
0,800 % éch. 17/11/2029		3 100	2 634	0,19
1,456 % éch. 14/01/2027	$	2 618	2 273	0,16
2,678 % éch. 29/06/2032		500	378	0,03
7,750 % éch. 02/04/2023 (f)(g)		600	597	0,04
7,767 % éch. 16/11/2028		900	955	0,07
Tesco Corporate Treasury Services PLC				
0,375 % éch. 27/07/2029	€	700	580	0,04
1,875 % éch. 02/11/2028	£	2 600	2 556	0,19
2,750 % éch. 27/04/2030		500	496	0,04
Thames Water Utilities Finance PLC				
0,875 % éch. 31/01/2028	€	3 000	2 730	0,20
Travis Perkins PLC				
3,750 % éch. 17/02/2026 (i)	£	1 000	1 069	0,08
Vmed O2 UK Financing PLC				
3,250 % éch. 31/01/2031	€	900	767	0,06
4,500 % éch. 15/07/2031	£	1 000	924	0,07
Vodafone Group PLC				
5,125 % éch. 04/06/2081	$	1 559	1 138	0,08
Weir Group PLC				
2,200 % éch. 13/05/2026		9 700	8 614	0,63
Workspace Group PLC				
2,250 % éch. 11/03/2028	£	1 600	1 435	0,10
Yorkshire Building Society				
3,511 % éch. 11/10/2030		2 400	2 439	0,18
Zenith Finco PLC				
6,500 % éch. 30/06/2027	£	2 300	$ 2 170	0,16
			100 222	7,31
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES				
Gemgarto PLC				
3,999 % éch. 16/12/2067		539	638	0,05
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Bon du Trésor britannique				
0,875 % éch. 31/07/2033		6 350	5 704	0,42
1,250 % éch. 22/07/2027		4 600	4 989	0,36
			10 693	0,78
Total Royaume-Uni			111 553	8,14
ÉTATS-UNIS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust				
2,100 % éch. 20/05/2048	$	2 901	2 071	0,15
4,000 % éch. 20/04/2049		5 532	4 511	0,33
4,950 % éch. 20/07/2049		6 538	6 067	0,44
			12 649	0,92
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AES Corp.				
1,375 % éch. 15/01/2026		4 319	3 840	0,28
2,450 % éch. 15/01/2031		5 600	4 468	0,33
Alcon Finance Corp.				
3,000 % éch. 23/09/2029		1 900	1 659	0,12
Alexandria Real Estate Equities, Inc.				
2,000 % éch. 18/05/2032		1 650	1 268	0,09
2,950 % éch. 15/03/2034		2 100	1 709	0,12
Allegion U.S. Holding Co., Inc.				
3,550 % éch. 01/10/2027		1 230	1 112	0,08
Ally Financial, Inc.				
2,200 % éch. 02/11/2028		400	313	0,02
3,050 % éch. 05/06/2023		100	99	0,01
Alphabet, Inc.				
1,100 % éch. 15/08/2030		800	628	0,05
American Express Co.				
3,400 % éch. 27/02/2023		400	400	0,03
4,050 % éch. 03/05/2029		2 900	2 768	0,20
5,210 % éch. 03/08/2023		2 062	2 063	0,15
American Tower Corp.				
0,500 % éch. 15/01/2028	€	400	351	0,03
0,950 % éch. 05/10/2030		900	737	0,05
1,000 % éch. 15/01/2032		100	79	0,01
1,450 % éch. 15/09/2026	$	400	350	0,03
1,875 % éch. 15/10/2030		5 600	4 334	0,32
1,950 % éch. 22/05/2026	€	200	198	0,01
2,100 % éch. 15/06/2030	$	1 000	794	0,06
3,650 % éch. 15/03/2027		1 000	935	0,07
4,050 % éch. 15/03/2032		400	358	0,03
Amgen, Inc.				
2,300 % éch. 25/02/2031		1 100	899	0,07
Apple, Inc.				
1,400 % éch. 05/08/2028		6 100	5 179	0,38
2,200 % éch. 11/09/2029		1 961	1 700	0,12
2,450 % éch. 04/08/2026		1 400	1 300	0,09
Arizona Public Service Co.				
2,650 % éch. 15/09/2050		900	526	0,04
AT&T, Inc.				
4,850 % éch. 25/05/2047 (h)	CAD	1 500	963	0,07
Autodesk, Inc.				
2,400 % éch. 15/12/2031	$	2 900	2 324	0,17
AvalonBay Communities, Inc.				
2,050 % éch. 15/01/2032		425	335	0,02
Bank of America Corp.				
1,102 % éch. 24/05/2032	€	300	246	0,02
1,734 % éch. 22/07/2027	$	300	263	0,02
2,087 % éch. 14/06/2029		2 400	2 024	0,15
2,299 % éch. 21/07/2032		600	463	0,03
2,456 % éch. 22/10/2025		1 700	1 607	0,12
2,687 % éch. 22/04/2032		6 600	5 298	0,39
2,824 % éch. 27/04/2033	€	700	655	0,05
2,863 % éch. 24/08/2025		600	638	0,05
2,972 % éch. 04/02/2033	$	300	242	0,02

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
3,384 % éch. 02/04/2026	$	7 800	$ 7 456	0,54
3,559 % éch. 23/04/2027		2 600	2 439	0,18
6,204 % éch. 10/11/2028		4 060	4 199	0,31
Bank of New York Mellon Corp.				
5,802 % éch. 25/10/2028		3 500	3 625	0,26
BlueHub Loan Fund, Inc.				
3,099 % éch. 01/01/2030		650	564	0,04
Boston Properties LP				
2,550 % éch. 01/04/2032		1 930	1 472	0,11
Bush Foundation				
2,754 % éch. 01/10/2050		375	245	0,02
CBRE Services, Inc.				
2,500 % éch. 01/04/2031		1 000	791	0,06
Centene Corp.				
3,000 % éch. 15/10/2030		6 000	4 932	0,36
Charles Schwab Corp.				
4,000 % éch. 01/12/2030 (f)		1 400	1 116	0,08
Chubb INA Holdings, Inc.				
0,875 % éch. 15/06/2027	€	200	187	0,01
Cigna Corp.				
3,750 % éch. 15/07/2023	$	163	162	0,01
Citigroup, Inc.				
2,572 % éch. 03/06/2031 (h)		8 700	7 056	0,51
4,615 % éch. 25/01/2026 (h)		2 000	1 956	0,14
Clearway Energy Operating LLC				
3,750 % éch. 15/01/2032		700	564	0,04
Community Preservation Corp.				
2,867 % éch. 01/02/2030		1 225	1 036	0,08
Conagra Brands, Inc.				
1,375 % éch. 01/11/2027		600	501	0,04
Continental Wind LLC				
6,000 % éch. 28/02/2033		2 515	2 523	0,18
Corebridge Financial, Inc.				
3,900 % éch. 05/04/2032		6 700	5 870	0,43
Corporate Office Properties LP				
2,000 % éch. 15/01/2029		700	538	0,04
2,250 % éch. 15/03/2026		500	439	0,03
Crown Castle, Inc.				
2,500 % éch. 15/07/2031		1 000	808	0,06
3,250 % éch. 15/01/2051		600	393	0,03
5,200 % éch. 15/02/2049		100	90	0,01
CVS Health Corp.				
4,300 % éch. 25/03/2028		192	186	0,01
Dell International LLC				
3,375 % éch. 15/12/2041		1 470	990	0,07
5,300 % éch. 01/10/2029		2 000	1 961	0,14
Digital Euro Finco LLC				
2,500 % éch. 16/01/2026	€	850	842	0,06
Digital Stout Holding LLC				
3,300 % éch. 19/07/2029	£	100	101	0,01
3,750 % éch. 17/10/2030		400	403	0,03
Discover Bank				
3,450 % éch. 27/07/2026	$	3 860	3 559	0,26
Discovery Communications LLC				
4,875 % éch. 01/04/2043		1 900	1 427	0,10
Doris Duke Charitable Foundation				
2,345 % éch. 01/07/2050		400	236	0,02
DTE Electric Co.				
3,250 % éch. 01/04/2051		1 100	793	0,06
3,950 % éch. 01/03/2049		700	577	0,04
Duke Energy Florida LLC				
2,500 % éch. 01/12/2029		300	257	0,02
Elevance Health, Inc.				
2,875 % éch. 15/09/2029		1 812	1 596	0,12
Empower Finance LP				
1,776 % éch. 17/03/2031		3 400	2 564	0,19
Equitable Financial Life Global Funding				
1,300 % éch. 12/07/2026		3 550	3 077	0,22
5,500 % éch. 02/12/2025		2 000	1 998	0,15
ERAC USA Finance LLC				
3,800 % éch. 01/11/2025		5 000	4 786	0,35
Eversource Energy				
1,650 % éch. 15/08/2030		800	624	0,05
F&G Global Funding				
2,300 % éch. 11/04/2027		2 000	1 761	0,13

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FactSet Research Systems, Inc.				
3,450 % éch. 01/03/2032	$	4 100	$ 3 448	0,25
Farmers Exchange Capital				
5,454 % éch. 15/10/2054		400	366	0,03
First American Financial Corp.				
2,400 % éch. 15/08/2031		3 600	2 640	0,19
4,000 % éch. 15/05/2030		700	588	0,04
Fiserv, Inc.				
3,000 % éch. 01/07/2031	£	100	100	0,01
Ford Motor Credit Co. LLC				
1,514 % éch. 17/02/2023	€	400	424	0,03
1,744 % éch. 19/07/2024		900	920	0,07
2,300 % éch. 10/02/2025	$	1 000	915	0,07
2,684 % éch. 01/12/2024	€	200	206	0,01
2,900 % éch. 10/02/2029	$	700	560	0,04
3,021 % éch. 06/03/2024	€	300	315	0,02
3,375 % éch. 13/11/2025	$	800	725	0,05
4,535 % éch. 06/03/2025	£	400	458	0,03
FS KKR Capital Corp.				
3,125 % éch. 12/10/2028	$	1 300	1 050	0,08
Gap, Inc.				
3,625 % éch. 01/10/2029		1 050	742	0,05
Goldman Sachs Group, Inc.				
1,000 % éch. 16/12/2025	£	200	222	0,02
1,500 % éch. 07/12/2027		800	802	0,06
1,992 % éch. 27/01/2032	$	1 000	764	0,06
2,383 % éch. 21/07/2032		900	700	0,05
2,615 % éch. 22/04/2032		5 600	4 479	0,33
2,640 % éch. 24/02/2028		3 300	2 943	0,21
2,650 % éch. 21/10/2032		900	713	0,05
3,102 % éch. 24/02/2033		1 100	896	0,07
3,250 % éch. 01/02/2023	€	115	123	0,01
3,691 % éch. 05/06/2028	$	500	465	0,03
Goodman U.S. Finance Five LLC				
4,625 % éch. 04/05/2032		4 100	3 749	0,27
GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC				
3,375 % éch. 24/03/2029		6 050	5 453	0,40
HAT Holdings LLC				
3,375 % éch. 15/06/2026		255	222	0,02
HCA, Inc.				
4,125 % éch. 15/06/2029		4 700	4 300	0,31
4,500 % éch. 15/02/2027		1 700	1 641	0,12
Healthpeak Properties, Inc.				
2,125 % éch. 01/12/2028		1 750	1 470	0,11
Host Hotels & Resorts LP				
2,900 % éch. 15/12/2031		2 200	1 688	0,12
3,375 % éch. 15/12/2029		5 400	4 526	0,33
Hudson Pacific Properties LP				
3,950 % éch. 01/11/2027		1 370	1 168	0,08
5,950 % éch. 15/02/2028		3 600	3 367	0,25
Humana, Inc.				
1,350 % éch. 03/02/2027		2 000	1 732	0,13
3,700 % éch. 23/03/2029		3 200	2 936	0,21
3,950 % éch. 15/03/2027		95	91	0,01
5,875 % éch. 01/03/2033		2 000	2 071	0,15
International Flavors & Fragrances, Inc.				
1,832 % éch. 15/10/2027		1 600	1 345	0,10
Interstate Power & Light Co.				
3,600 % éch. 01/04/2029		1 200	1 100	0,08
John Deere Capital Corp.				
3,350 % éch. 18/04/2029		1 900	1 760	0,13
JPMorgan Chase & Co.				
2,545 % éch. 08/11/2032		8 750	6 938	0,51
2,580 % éch. 22/04/2032		6 500	5 222	0,38
4,323 % éch. 26/04/2028		3 500	3 348	0,24
4,565 % éch. 14/06/2030		300	283	0,02
Kaiser Foundation Hospitals				
2,810 % éch. 01/06/2041		2 850	2 077	0,15
Keurig Dr Pepper, Inc.				
4,050 % éch. 15/04/2032		1 400	1 278	0,09
Kilroy Realty LP				
2,650 % éch. 15/11/2033		6 400	4 457	0,33
Kraft Heinz Foods Co.				
4,125 % éch. 01/07/2027	£	100	115	0,01
Liberty Utilities Finance GP				
2,050 % éch. 15/09/2030	$	500	377	0,03

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Fonds Low Income Investment Fund				
3,711 % éch. 01/07/2029	$	300	$ 282	0,02
Merck & Co., Inc.				
1,900 % éch. 10/12/2028		2 000	1 721	0,13
Micron Technology, Inc.				
2,703 % éch. 15/04/2032		1 800	1 350	0,10
Microsoft Corp.				
2,675 % éch. 01/06/2060		393	251	0,02
MidAmerican Energy Co.				
2,700 % éch. 01/08/2052		1 750	1 129	0,08
Moody's Corp.				
2,000 % éch. 19/08/2031		700	555	0,04
2,550 % éch. 18/08/2060		500	283	0,02
Morgan Stanley				
1,928 % éch. 28/04/2032		8 900	6 736	0,49
Morgan Stanley Domestic Holdings, Inc.				
3,800 % éch. 24/08/2027		200	189	0,01
4,500 % éch. 20/06/2028		1 500	1 461	0,11
MPT Operating Partnership LP				
2,550 % éch. 05/12/2023	£	200	229	0,02
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.				
4,150 % éch. 15/12/2032	$	5 100	4 725	0,34
Netflix, Inc.				
3,875 % éch. 15/11/2029	€	4 400	4 402	0,32
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
1,900 % éch. 15/06/2028	$	4 000	3 422	0,25
Niagara Mohawk Power Corp.				
5,783 % éch. 16/09/2052		3 450	3 458	0,25
Northern States Power Co.				
2,600 % éch. 01/06/2051		1 300	830	0,06
2,900 % éch. 01/03/2050		1 300	895	0,07
NSTAR Electric Co.				
4,950 % éch. 15/09/2052		1 300	1 264	0,09
NVR, Inc.				
3,000 % éch. 15/05/2030		2 000	1 683	0,12
Oracle Corp.				
3,950 % éch. 25/03/2051 (h)		300	215	0,02
Owens Corning				
3,875 % éch. 01/06/2030		4 500	4 009	0,29
Pacific Life Global Funding				
1,375 % éch. 14/04/2026		605	534	0,04
2,450 % éch. 11/01/2032		2 000	1 572	0,11
5,051 % éch. 06/12/2024		2 000	1 999	0,15
PacifiCorp				
5,350 % éch. 01/12/2053		1 200	1 195	0,09
Penn Mutual Life Insurance Co.				
3,800 % éch. 29/04/2061		1 800	1 196	0,09
PepsiCo, Inc.				
2,625 % éch. 29/07/2029		1 400	1 238	0,09
PG&E Recovery Funding LLC				
5,536 % éch. 15/07/2049		2 200	2 240	0,16
PNC Bank N.A.				
2,700 % éch. 22/10/2029		600	508	0,04
Principal Life Global Funding				
1,250 % éch. 16/08/2026		2 750	2 388	0,17
1,375 % éch. 10/01/2025		2 000	1 852	0,13
Prologis Euro Finance LLC				
1,500 % éch. 08/02/2034	€	3 000	2 407	0,18
Prologis LP				
2,250 % éch. 15/01/2032	$	3 000	2 386	0,17
Protective Life Global Funding				
5,335 % éch. 11/12/2024		5 000	5 001	0,36
Public Service Co. of Colorado				
2,700 % éch. 15/01/2051		625	406	0,03
3,200 % éch. 01/03/2050		400	286	0,02
3,700 % éch. 15/06/2028		2 100	2 003	0,15
Public Service Co. of Oklahoma				
3,150 % éch. 15/08/2051		2 200	1 469	0,11
Public Service Electric & Gas Co.				
3,100 % éch. 15/03/2032		2 950	2 587	0,19
Qorvo, Inc.				
1,750 % éch. 15/12/2024		4 900	4 519	0,33
Quanta Services, Inc.				
2,900 % éch. 01/10/2030		3 000	2 474	0,18
Rayonier LP				
2,750 % éch. 17/05/2031		2 500	2 014	0,15

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Realty Income Corp.			
1,750 % éch. 13/07/2033	£ 2 000	$ 1 661	0,12
Regency Centers LP			
2,950 % éch. 15/09/2029	$ 1 100	926	0,07
Reliance Steel & Aluminum Co.			
2,150 % éch. 15/08/2030	1 000	790	0,06
Rexford Industrial Realty LP			
2,150 % éch. 01/09/2031	950	730	0,05
S&P Global, Inc.			
2,700 % éch. 01/03/2029	5 500	4 852	0,35
salesforce.com, Inc.			
1,500 % éch. 15/07/2028	1 750	1 496	0,11
San Diego Gas & Electric Co.			
2,950 % éch. 15/08/2051	1 750	1 191	0,09
Santander Holdings USA, Inc.			
2,490 % éch. 06/01/2028	1 400	1 203	0,09
SLM Corp.			
3,125 % éch. 02/11/2026	1 400	1 192	0,09
Solar Star Funding LLC			
5,375 % éch. 30/06/2035	1 888	1 838	0,13
Southern California Edison Co.			
3,600 % éch. 01/02/2045	1 200	866	0,06
3,650 % éch. 01/06/2051	2 500	1 830	0,13
3,900 % éch. 01/12/2041	100	75	0,01
5,850 % éch. 01/11/2027	700	722	0,05
5,950 % éch. 01/11/2032	4 500	4 769	0,35
Southwestern Public Service Co.			
5,150 % éch. 01/06/2052	2 000	1 849	0,13
Sprint LLC			
7,875 % éch. 15/09/2023	100	102	0,01
Standard Industries, Inc.			
2,250 % éch. 21/11/2026	€ 1 600	1 467	0,11
State Street Corp.			
5,751 % éch. 04/11/2026	$ 2 600	2 664	0,19
SVB Financial Group			
4,100 % éch. 15/02/2031 (f)	1 200	699	0,05
T-Mobile USA, Inc.			
2,550 % éch. 15/02/2031	2 000	1 639	0,12
2,625 % éch. 15/02/2029	1 000	848	0,06
3,300 % éch. 15/02/2051	900	605	0,04
Topaz Solar Farms LLC			
5,750 % éch. 30/09/2039	1 347	1 280	0,09
Toyota Motor Credit Corp.			
3,050 % éch. 22/03/2027	1 300	1 214	0,09
5,050 % éch. 11/12/2023	3 200	3 205	0,23
Truist Financial Corp.			
1,267 % éch. 02/03/2027	1 900	1 686	0,12
UDR, Inc.			
2,100 % éch. 01/08/2032	400	295	0,02
UnitedHealth Group, Inc.			
5,350 % éch. 15/02/2033	800	828	0,06
5,875 % éch. 15/02/2053	600	652	0,05
USAA Capital Corp.			
2,125 % éch. 01/05/2030	1 000	822	0,06
VeriSign, Inc.			
2,700 % éch. 15/06/2031	1 100	899	0,07
Verizon Communications, Inc.			
1,500 % éch. 18/09/2030	5 560	4 335	0,32
2,100 % éch. 22/03/2028	$ 700	$ 609	0,04
2,850 % éch. 03/09/2041	1 550	1 073	0,08
3,875 % éch. 08/02/2029	2 400	2 257	0,16
VMware, Inc.			
2,200 % éch. 15/08/2031	1 000	761	0,06
4,700 % éch. 15/05/2030	3 000	2 798	0,20
Warnermedia Holdings, Inc.			
3,755 % éch. 15/03/2027	700	631	0,05
4,054 % éch. 15/03/2029	700	607	0,04
4,279 % éch. 15/03/2032	2 500	2 066	0,15
5,391 % éch. 15/03/2062	500	367	0,03
Wells Fargo & Co.			
4,540 % éch. 15/08/2026	6 200	6 082	0,44
Welltower, Inc.			
3,850 % éch. 15/06/2032	2 900	2 469	0,18
Weyerhaeuser Co.			
6,875 % éch. 15/12/2033	70	75	0,01
Wisconsin Electric Power Co.			
4,750 % éch. 30/09/2032	1 850	1 819	0,13
Wisconsin Public Service Corp.			
2,850 % éch. 01/12/2051	2 250	1 449	0,11
WP Carey, Inc.			
2,450 % éch. 01/02/2032	2 200	1 725	0,13
Xylem, Inc.			
2,250 % éch. 30/01/2031	2 100	1 709	0,12
ZF North America Capital, Inc.			
2,750 % éch. 27/04/2023	€ 200	213	0,02
Zoetis, Inc.			
2,000 % éch. 15/05/2030	$ 6 100	4 964	0,36
		378 370	27,62
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			
IQVIA, Inc.			
4,202 % éch. 07/03/2024	€ 1 000	1 068	0,08
TerraForm Power Operating LLC			
7,430 % éch. 21/05/2029	$ 1 990	1 979	0,14
		3 047	0,22
OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX			
Obligations California Health Facilities Financing Authority Revenue Bonds, Series 2022			
4,190 % éch. 01/06/2037	2 100	1 880	0,14
Obligations University of Michigan Revenue Bonds, Series 2022			
3,504 % éch. 01/04/2052	1 300	1 016	0,07
		2 896	0,21
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Freddie Mac			
1,021 % éch. 25/08/2029 (a)	2 325	117	0,01
Uniform Mortgage-Backed Security			
3,000 % éch. 01/07/2052	6 663	5 857	0,42
3,500 % éch. 01/12/2052	100	91	0,01
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,500 % éch. 01/02/2053	14 900	13 547	0,99
4,000 % éch. 01/02/2053	62 900	59 026	4,31
		78 638	5,74
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Obligations du Trésor américain			
1,750 % éch. 15/08/2041	$ 33 200	$ 22 736	1,66
1,875 % éch. 15/02/2041 (i)	17 500	12 379	0,90
2,000 % éch. 15/11/2041	39 500	28 223	2,06
2,250 % éch. 15/05/2041	35 400	26 632	1,95
2,375 % éch. 15/02/2042 (i)	57 200	43 701	3,19
2,875 % éch. 15/05/2052 (i)	2 620	2 100	0,15
3,250 % éch. 15/05/2042	45 000	39 473	2,88
3,375 % éch. 15/08/2042 (i)	12 300	10 997	0,80
4,000 % éch. 15/11/2042 (j)	23 300	22 819	1,67
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e)			
0,625 % éch. 15/07/2032 (j)	30 869	28 300	2,07
Billets du Trésor américain			
0,500 % éch. 30/11/2023	22 700	21 841	1,60
0,750 % éch. 30/04/2026	7 400	6 617	0,48
3,125 % éch. 31/08/2027 (i)	3 250	3 126	0,23
4,250 % éch. 15/10/2025 (i)	21 700	21 686	1,58
		290 630	21,22
Total États-Unis		766 230	55,93
ÎLES VIERGES BRITANNIQUES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
TSMC Global Ltd.			
1,250 % éch. 23/04/2026	3 600	3 228	0,24
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BILLETS DE TRÉSORERIE			
AT&T, Inc.			
4,650 % éch. 13/01/2023	€ 11 500	11 479	0,84
Baxter International, Inc.			
4,730 % éch. 23/01/2023	1 000	997	0,07
Électricité de France S.A.			
5,000 % éch. 20/01/2023	5 500	5 485	0,40
Fidelity National Information Services, Inc.			
4,580 % éch. 10/01/2023	12 000	11 983	0,87
Humana, Inc.			
4,850 % éch. 19/01/2023	17 800	17 754	1,30
Medtronic Global Holdings S.C.A.			
4,750 % éch. 27/01/2023	4 000	3 986	0,29
Oracle Corp.			
4,580 % éch. 04/01/2023	10 000	9 994	0,73
Walgreens Boots Alliance, Inc.			
4,900 % éch. 11/01/2023	4 000	3 994	0,29
4,950 % éch. 18/01/2023	1 500	1 496	0,11
		67 168	4,90
BONS DU TRÉSOR AUTRICHIEN			
1,267 % éch. 23/02/2023 (c)(d)	11 725	12 493	0,91
Total instruments à court terme		79 661	5,81
Total des valeurs mobilières		**$ 1 489 771**	**108,75**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux directeur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Accords de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	en % de l'actif net
SSB	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 15 240	Billet du Trésor américain 1,875 % échéance 30/06/2026	$ (15 545)	$ 15 240	$ 15 242	1,11
Total des contrats de mise en pension						**$ (15 545)**	**$ 15 240**	**$ 15 242**	**1,11**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars	Long	03/2023	134	$ (600)	(0,04)
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement canadien à 10 ans mars	Long	03/2023	86	(133)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Court	03/2023	2	8	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	445	4 118	0,30
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	Court	03/2023	57	1 432	0,10
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Court	03/2023	12	243	0,02
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Long	03/2023	342	90	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	286	(85)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Court	03/2023	238	72	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	267	(82)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	1 649	2 519	0,19
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme décembre	Long	03/2023	295	(2 374)	(0,17)
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Court	03/2023	135	1 036	0,07
				$ 6 244	0,46
Total des instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé				$ 6 244	0,46

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
Koninklijke KPN NV	(1,000) %	20/12/2023	€ 200	$ (6)	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[2]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
American International Group, Inc.	1,000 %	20/12/2026	$ 900	$ (12)	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20/12/2027	1 000	8	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2023	2 100	(23)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	3 200	(50)	(0,01)
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2025	€ 100	(1)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2027	300	(4)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/06/2028	1 600	(46)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2028	400	(10)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2027	$ 600	(8)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2024	300	7	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2024	800	20	0,00
Goldman Sachs Group, Inc.	1,000	20/12/2026	3 000	(21)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20/06/2026	€ 100	(1)	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20/06/2028	900	(15)	0,00
Tesco PLC	1,000	20/06/2028	600	(20)	0,00
Valeo S.A.	1,000	20/06/2026	300	(10)	0,00
Valeo S.A.	1,000	20/06/2028	900	(46)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2026	$ 700	(15)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2026	2 200	(52)	(0,01)
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2027	5 000	(8)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2027	4 100	27	0,00
				$ (280)	(0,02)

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
À recevoir[4]	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	2,000 %	15/03/2053	£ 1 000	$ 9	0,00
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2024	$ 40 600	(1 032)	(0,08)
À payer	BRL-CDI à 1 an	13,026	02/01/2025	BRL 243 200	252	0,02
À payer	Billet CAD-Bank à 3 mois	1,000	16/06/2026	CAD 13 800	(783)	(0,06)
À payer	Billet CAD-Bank à 3 mois	1,220	03/03/2025	600	(34)	0,00
À payer	Billet CAD-Bank à 3 mois	1,235	04/03/2025	1 100	(63)	(0,01)
À payer	Billet CAD-Bank à 3 mois	1,275	03/03/2025	600	(33)	0,00
À payer	Billet CAD-Bank à 3 mois	1,276	03/03/2025	300	(16)	0,00
À payer	Billet CAD-Bank à 3 mois	1,290	03/03/2025	200	(11)	0,00
À payer	Billet CAD-Bank à 3 mois	1,500	17/06/2030	500	(35)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,785	12/08/2051	$ 800	263	0,02
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,600	15/12/2050	€ 3 100	1 703	0,12
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2025	10 600	(136)	(0,01)

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500 %	15/03/2028	€ 83 600	$ (3 791)	(0,28)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	9 800	(311)	(0,02)
À recevoir	CPURNSA	2,475	16/06/2031	$ 2 600	213	0,02
					$ (3 805)	(0,28)
Total des instruments financiers dérivés compensés					**$ (4 091)**	**(0,30)**

(1) Si le Fonds est acheteur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds recevra (i) de la part du vendeur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et livrera l'obligation de référence ou les titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, de titres ou autres obligations livrables, égal au montant nominal du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(2) Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(3) Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, tel que défini par les termes de ce contrat de swap précis.

(4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Voir note 2, Transactions sur titres et revenus sur investissements, dans les Notes relatives aux États financiers pour plus d'informations.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	en % de l'actif net
BOA	Option d'achat – Uniform Mortgage-Backed Security de gré à gré, TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	$ 101,891	05/01/2023	6 100	$ (18)	$ 0	0,00
SAL	Option d'achat – Uniform Mortgage-Backed Security de gré à gré, TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	101,859	05/01/2023	7 700	(23)	0	0,00
					$ (41)	$ 0	0,00

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	en % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000 %	20/12/2026	$ 2 300	$ 11	$ (20)	$ (9)	0,00

(1) Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(2) Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, tel que défini par les termes de ce contrat de swap précis.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	02/2023	CAD	20 181	$	15 201	$ 303	$ 0	$ 303	0,02
	02/2023	£	56 617		66 881	28	(1 327)	(1 299)	(0,09)
	02/2023	SEK	8 284		800	3	0	3	0,00
	02/2023	$	2 911	¥	400 400	141	0	141	0,01
	02/2023		1 189	NOK	11 798	11	0	11	0,00
	03/2023	ZAR	35 698	$	2 022	0	(64)	(64)	0,00
BPS	01/2023	$	808	€	758	1	0	1	0,00
BRC	02/2023		1 803	NOK	17 991	27	0	27	0,00
CBK	01/2023	BRL	57	$	11	0	0	0	0,00
	01/2023	€	640		666	0	(18)	(18)	0,00
	01/2023	$	979	€	921	4	0	4	0,00
	01/2023		92	PEN	370	5	0	5	0,00
	02/2023	AUD	7 521	$	5 040	0	(70)	(70)	(0,01)
	02/2023	£	986		1 197	13	(4)	9	0,00
	02/2023	$	1 486	CAD	2 022	7	0	7	0,00
	02/2023		1 162	£	954	0	(13)	(13)	0,00
GLM	01/2023		11	BRL	57	0	0	0	0,00
	02/2023	BRL	57	$	11	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	€	304 156		318 843	0	(5 907)	(5 907)	(0,43)
	01/2023	$	1 238	€	1 162	3	0	3	0,00
	02/2023	£	249	$	304	4	0	4	0,00
	02/2023	$	2 788	AUD	4 126	14	0	14	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
	02/2023	$	1 829	¥	246 600	$ 50	$ 0	$ 50	0,01
MYI	01/2023	€	449	$	479	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	£	8		9	0	0	0	0,00
	01/2023	SEK	7 131		683	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$	704	£	584	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	SEK	5 910	$	572	3	0	3	0,00
SCX	02/2023	AUD	192		129	0	(2)	(2)	0,00
	02/2023	CAD	310		229	0	0	0	0,00
	02/2023	$	1 898	NOK	18 775	11	0	11	0,00
	04/2023	ZAR	30 062	$	1 634	0	(118)	(118)	(0,01)
						$ 628	$ (7 527)	$ (6 899)	(0,50)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de Capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de Distribution, E en CHF (couverte) de Capitalisation et E en CHF (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	CHF	28	$	30	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$	72 764	CHF	68 802	1 648	0	1 648	0,12
BRC	01/2023	CHF	9	$	10	0	0	0	0,00
	01/2023	$	5 761	CHF	5 353	29	0	29	0,00
CBK	01/2023	CHF	4	$	4	0	0	0	0,00
	01/2023	$	125 400	CHF	118 491	2 752	0	2 752	0,20
MBC	01/2023	CHF	156	$	169	0	0	0	0,00
	01/2023	$	67	CHF	63	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	CHF	151	$	162	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	1 023	CHF	966	22	0	22	0,00
SCX	01/2023	CHF	425	$	460	0	0	0	0,00
	01/2023	$	207	CHF	192	1	0	1	0,00
						$ 4 452	$ (1)	$ 4 451	0,32

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de Capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de Distribution, E en EUR (couverte) de Capitalisation et E en EUR (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	€	2 339	$	2 467	$ 0	$ (30)	$ (30)	0,00
BPS	01/2023	$	259	€	243	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	€	446	$	475	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$	168 665	€	162 670	5 019	0	5 019	0,37
MBC	01/2023	€	2 109	$	2 249	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	$	217 749	€	207 752	4 069	0	4 069	0,30
SCX	01/2023		188 592		181 190	4 866	0	4 866	0,35
						$ 13 954	$ (35)	$ 13 919	1,02

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de Capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de Distribution et E en GBP (couverte) de Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	£	832	$	1 023	$ 22	$ 0	$ 22	0,00
	01/2023	$	60 121	£	49 947	0	(31)	(31)	0,00
BPS	01/2023	£	57	$	69	0	0	0	0,00
BRC	01/2023		569		685	1	0	1	0,00
	01/2023	$	3	£	2	0	0	0	0,00
JPM	01/2023		66 073		54 717	0	(244)	(244)	(0,02)
MBC	01/2023	£	32	$	39	0	0	0	0,00
	01/2023	$	72 114	£	60 110	288	(84)	204	0,02
MYI	01/2023	£	2 359	$	2 900	61	0	61	0,00
	01/2023	$	19	£	16	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	£	246	$	304	9	0	9	0,00
	01/2023	$	59	£	48	0	(1)	(1)	0,00
						$ 381	$ (360)	$ 21	0,00

Tableau des investissements Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)

Au 31 décembre 2022, la Catégorie d'actions de capitalisation couverte en SEK et la Catégorie d'actions de capitalisation administrative couverte en SEK avaient en cours les contrats de change à terme suivants :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	$	5 408	SEK	55 657	$ 0	$ (64)	$ (64)	(0,01)
BRC	01/2023		84 300		882 904	467	0	467	0,03
CBK	01/2023		17 065		177 382	5	(40)	(35)	0,00
MBC	01/2023	SEK	7 225	$	694	0	0	0	0,00
	01/2023	$	3 098	SEK	32 039	8	(30)	(22)	0,00
MYI	01/2023		24 902		261 784	237	(6)	231	0,02
SCX	01/2023		1 439		14 837	0	(14)	(14)	0,00
UAG	01/2023		159 109		1 668 944	1 141	(16)	1 125	0,08
						$ 1 858	$ (170)	$ 1 688	0,12
Total des instruments financiers dérivés hors cote								**$ 13 171**	**0,96**

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
3,000 % éch. 01/02/2053	$ 6 700	$ (5 887)	(0,43)
Total des titres vendus à découvert		**$ (5 887)**	**(0,43)**
Total des investissements		**$ 1 514 448**	**110,55**
Autres actifs et passifs courants		**$ (144 558)**	**(10,55)**
Actifs nets		**$ 1 369 890**	**100,00**

ANNEXES À L'ÉTAT DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(a) Le titre est une obligation Interest Only (« IO ») ou une obligation zéro-coupon (IO Strip).

(b) Titre à l'émission.

(c) Titres à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement à échéance.

(e) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(f) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date d'achat contractuel.

(g) Titre convertible conditionnel.

(h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 1,42 %) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	en % de l'actif net
AT&T, Inc.	4,850 %	25/05/2047	23/09/2021	$ 1 326	$ 963	0,07
Citigroup, Inc.	2,572	03/06/2031	29/12/2021	8 764	7 056	0,51
Citigroup, Inc.	4,615	25/01/2026	18/01/2022	2 000	1 956	0,14
Deutsche Bank AG	1,447	01/04/2025	23/09/2021	2 005	1 858	0,13
Oracle Corp.	3,950	25/03/2051	22/03/2021	299	215	0,02
				$ 14 394	$ 12 048	0,87

(i) Des titres d'une juste valeur globale de 74 895 $ (31 décembre 2021 : 0 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

(j) Des titres d'une juste valeur globale de 22 792 $ (31 décembre 2021 : 0 $) ont été nantis ou livrés en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 28 652 $ (31 décembre 2021 : 9 154 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 1 380 $ (31 décembre 2021 : 0 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 0	$ 1 489 771	$ 0	$ 1 489 771
Contrats de mise en pension	0	15 240	0	15 240
Instruments financiers dérivés[3]	3 729	11 595	0	15 324
Titres vendus à découvert	0	(5 887)	0	(5 887)
Totaux	**$ 3 729**	**$ 1 510 719**	**$ 0**	**$ 1 514 448**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 0	$ 1 166 597	$ 0	$ 1 166 597
Contrats de mise en pension	0	962	0	962
Instruments financiers dérivés[3]	987	7 174	0	8 161
Totaux	**$ 987**	**$ 1 174 733**	**$ 0**	**$ 1 175 720**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	en % de l'actif net
BOS	4,300 %	01/12/2022	05/01/2023	$ (11 285)	$ (11 327)	(0,83)
	4,340	08/12/2022	05/01/2023	(46 868)	(47 003)	(3,43)
	4,430	12/12/2022	05/01/2023	(16 759)	(16 800)	(1,22)
BRC	1,000	26/05/2022	TBD [1]	£ (669)	(798)	(0,06)
Total des contrats de prise en pension					**$ (75 928)**	**(5,54)**

(1) Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos[1]	en % de l'actif net
BPG	(1,500) %	30/12/2022	03/01/2023	$ (22 342)	$ (22 339)	(1,63)
	(1,350)	29/12/2022	30/12/2022	(15 191)	(15 190)	(1,11)
	(1,070)	27/12/2022	28/12/2022	(15 104)	(15 104)	(1,10)
	(1,000)	28/12/2022	29/12/2022	(22 609)	(22 609)	(1,65)
MSC	4,400	09/12/2022	05/01/2023	(682)	(684)	(0,05)
Opérations de financement de vente et rachat dos-à-dos					**$ (75 926)**	**(5,54)**

(1) Le montant à payer sur opération par vente et rachat dos-à-dos comprend 1 $ de baisse de prix différée.

Garantie (reçue)/nantie d'instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ 631	$ (740)	$ (109)	$ 214	$ (270)	$ (56)
BPS	1	0	1	3 069	(2 590)	479
BRC	524	(240)	284	1 340	(930)	410
CBK	7 658	(7 770)	(112)	308	(330)	(22)
GLM	S/O	S/O	S/O	323	0	323
HUS	S/O	S/O	S/O	244	0	244
JPM	(244)	0	(244)	91	0	91
MBC	(1 588)	1 380	(208)	S/O	S/O	S/O
MYI	312	(100)	212	295	0	295
SCX	4 744	(4 520)	224	1 264	(1 500)	(236)
UAG	1 133	(520)	613	1 234	(650)	584

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Ce qui suit est une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières négociables admises à la cote sur une Bourse officielle	81,73	78,12
Valeurs mobilières négociables négociées sur un autre marché réglementé	26,66	19,89
Autres valeurs mobilières négociables	0,36	0,06
Contrats de mise en pension	1,11	0,08
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,46	(0,02)
Instruments financiers dérivés compensés	(0,30)	0,00
Instruments financiers dérivés hors cote	0,96	0,71
Titres vendus à découvert	(0,43)	S/O
Contrats de prise en pension	(5,54)	S/O
Opérations de financement de vente et rachat dos-à-dos	(5,54)	S/O

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Australie	0,41	0,94
Autriche	0,22	0,38
Belgique	0,65	0,55
Bermudes	S/O	0,10
Brésil	0,02	0,75
Canada	1,75	0,77
Îles Caïmans	0,27	1,02
Chili	0,44	0,50
Chine	S/O	0,26
Colombie	0,09	0,11
Croatie	S/O	0,03
Chypre	0,08	S/O
Danemark	0,79	0,25
Finlande	0,63	1,19
France	5,16	6,42
Allemagne	2,94	2,04
Guernesey, îles Anglo-Normandes	0,32	0,47
Hong Kong	0,01	0,29
Inde	0,96	0,50
Indonésie	S/O	0,51
Irlande	1,40	0,51
Île de Man	S/O	0,06
Italie	1,33	2,72
Japon	3,85	2,61
Jersey, îles Anglo-Normandes	0,09	0,15
Luxembourg	1,23	1,52
Île Maurice	0,18	0,85
Mexique	0,32	0,76
Multinational	0,63	0,34
Pays-Bas	7,21	6,62
Norvège	0,16	S/O
Panama	S/O	0,03
Pérou	0,11	0,19
Roumanie	0,29	0,38
Serbie	0,13	0,18
Singapour	0,35	0,20
Afrique du Sud	0,02	S/O
Corée du Sud	1,02	1,38
Espagne	1,34	3,09
Supranational	2,90	0,95
Suède	0,70	0,65
Suisse	0,63	1,11
Thaïlande	S/O	0,06
Royaume-Uni	8,14	9,79
États-Unis	55,93	44,41
Uruguay	S/O	0,08
Îles Vierges britanniques	0,24	0,30
Instruments à court terme	5,81	2,05
Contrats de mise en pension	1,11	0,08
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,46	(0,02)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines - achat de protection	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	(0,02)	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(0,28)	0,00
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Options sur titres	0,00	S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	0,00	0,00
Contrats de change à terme	(0,50)	(0,26)
Contrats de change à terme couverts	1,46	0,97
Titres vendus à découvert	(0,43)	S/O
Autres actifs et passifs courants	(10,55)	1,16
Actifs nets	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES NÉGOCIABLES				
AUSTRALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.				
3,900 % éch. 22/03/2023	$	1 100	$ 1 097	0,08
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement australien				
0,750 % éch. 21/11/2027	AUD	19 838	8 357	0,61
3,000 % éch. 20/09/2025		8 044	4 359	0,32
			12 716	0,93
Total Australie			13 813	1,01
CANADA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien				
4,250 % éch. 01/12/2026 (a)	CAD	2 626	2 139	0,16
ÎLES CAÏMANS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				
5,229 % éch. 16/01/2030	$	2 190	2 167	0,16
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.				
5,179 % éch. 15/10/2030		1 342	1 329	0,09
Sound Point CLO Ltd.				
5,029 % éch. 15/04/2029		4 120	4 072	0,30
Total Îles Caïmans			7 568	0,55
DANEMARK				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Jyske Realkredit A/S				
0,500 % éch. 01/10/2053	DKK	19 878	1 924	0,14
1,000 % éch. 01/10/2050		19	2	0,00
1,000 % éch. 01/10/2053		2 763	272	0,02
1,500 % éch. 01/10/2050		493	53	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		15 181	1 587	0,12
2,500 % éch. 01/10/2047		4	1	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
0,500 % éch. 01/10/2043		10 862	1 192	0,09
1,000 % éch. 01/10/2050		29	3	0,00
2,500 % éch. 01/10/2047		13	2	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
0,500 % éch. 01/10/2053		3 061	296	0,02
1,000 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,000 % éch. 01/10/2053		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		155 516	16 864	1,24
2,000 % éch. 01/10/2053		8 647	987	0,07
2,500 % éch. 01/10/2047		2	0	0,00
3,000 % éch. 01/10/2053		50 615	6 456	0,47
3,500 % éch. 01/10/2053		4 979	657	0,05
5,000 % éch. 01/10/2053		7 200	1 008	0,07
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050		29 687	3 143	0,23
1,000 % éch. 01/10/2053		6 407	671	0,05
1,500 % éch. 01/10/2050		16 276	1 759	0,13
1,500 % éch. 01/10/2053		0	0	0,00
2,500 % éch. 01/04/2047		9	1	0,00
3,000 % éch. 01/10/2053		27 189	3 472	0,26
			40 350	2,96
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement danois				
0,100 % éch. 15/11/2023 (a)		13 332	1 922	0,14
Total Danemark			42 272	3,10
FRANCE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement français				
0,100 % éch. 01/03/2025 (a)	€	9 854	10 608	0,78
0,100 % éch. 01/03/2026 (a)		3 905	4 125	0,30
0,100 % éch. 01/03/2028 (a)		13 908	14 860	1,09
0,100 % éch. 01/03/2029 (a)		580	601	0,04
0,100 % éch. 25/07/2031 (a)		7 936	8 111	0,59
0,100 % éch. 25/07/2036 (a)		237	227	0,02
0,100 % éch. 25/07/2038 (a)	€	3 275	$ 3 133	0,23
0,250 % éch. 25/07/2024 (a)		15 056	16 186	1,19
2,100 % éch. 25/07/2023 (a)		11 308	12 363	0,91
Total France			70 214	5,15
ALLEMAGNE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
République d'Allemagne				
0,100 % éch. 15/04/2023 (a)		16 844	17 832	1,31
0,100 % éch. 15/04/2026 (a)		18 216	19 280	1,41
0,500 % éch. 15/04/2030 (a)		24 119	26 083	1,91
Total Allemagne			63 195	4,63
IRLANDE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Adagio CLO DAC				
4,541 % éch. 20/07/2036		5 100	5 447	0,40
Ares European CLO DAC				
1,988 % éch. 15/04/2030		5 634	5 850	0,43
2,158 % éch. 15/10/2031		4 200	4 345	0,32
Bain Capital Euro CLO DAC				
2,236 % éch. 20/04/2032		400	417	0,03
Cairn CLO DAC				
2,158 % éch. 15/10/2031		1 700	1 776	0,13
2,688 % éch. 20/10/2028		582	609	0,04
Carlyle Euro CLO DAC				
2,078 % éch. 15/01/2031		800	833	0,06
Harvest CLO DAC				
2,228 % éch. 15/01/2032		1 600	1 655	0,12
2,433 % éch. 18/11/2029		649	683	0,05
Jubilee CLO DAC				
2,846 % éch. 15/12/2029		442	463	0,03
Palmer Square European Loan Funding DAC				
2,428 % éch. 15/10/2031		5 728	5 971	0,44
Palmerston Park CLO DAC				
2,053 % éch. 18/04/2030		1 274	1 337	0,10
St. Paul's CLO DAC				
2,373 % éch. 25/04/2030		4 988	5 184	0,38
			34 570	2,53
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES				
European Loan Conduit DAC				
2,803 % éch. 17/02/2030		1 271	1 297	0,10
Glenbeigh Issuer DAC				
2,875 % éch. 24/06/2050		6 042	6 265	0,46
Primrose Residential DAC				
2,644 % éch. 24/03/2061		3 534	3 684	0,27
Shamrock Residential DAC				
2,744 % éch. 24/12/2059		2 117	2 224	0,16
3,144 % éch. 24/02/2071		3 174	3 309	0,24
			16 779	1,23
Total Irlande			51 349	3,76
ITALIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
0,400 % éch. 15/05/2030 (a)		3 499	3 269	0,24
0,650 % éch. 15/05/2026 (a)		3 678	3 800	0,28
1,400 % éch. 26/05/2025 (a)		31 012	32 675	2,39
2,350 % éch. 15/09/2024 (a)		33 495	36 840	2,70
2,600 % éch. 15/09/2023 (a)		11 006	11 985	0,88
Total Italie			88 569	6,49
JAPON				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement japonais				
0,005 % éch. 10/03/2031 (a)	¥	187 873	1 476	0,11
0,100 % éch. 10/09/2024 (a)		579 150	4 499	0,33
0,100 % éch. 10/03/2025 (a)		1 364 115	10 597	0,78
0,100 % éch. 10/03/2026 (a)		2 836 487	22 260	1,63
0,100 % éch. 10/03/2028 (a)		1 572 344	12 328	0,90
0,100 % éch. 10/03/2029 (a)		2 223 869	17 495	1,28
Total Japon			68 655	5,03
LUXEMBOURG				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Delos Finance SARL				
6,480 % éch. 06/10/2023	$	70	$ 70	0,01
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES				
Miravet SARL				
2,758 % éch. 26/05/2065	€	2 157	2 225	0,16
Total Luxembourg			2 295	0,17
PAYS-BAS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Grosvenor Place CLO BV				
2,325 % éch. 30/10/2029		1 797	1 897	0,14
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES				
Eurosail BV				
2,878 % éch. 17/10/2040		669	711	0,05
Total Pays-Bas			2 608	0,19
NOUVELLE-ZÉLANDE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais				
2,000 % éch. 20/09/2025	NZD	15 401	6 227	0,46
3,000 % éch. 20/09/2030		1 930	816	0,06
Total Nouvelle-Zélande			7 043	0,52
PÉROU				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement péruvien				
5,940 % éch. 12/02/2029	PEN	4 900	1 180	0,09
SLOVÉNIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % éch. 05/02/2030	€	600	531	0,04
ESPAGNE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
BBVA Consumer Auto				
0,270 % éch. 20/07/2031		431	450	0,03
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement espagnol				
0,700 % éch. 30/11/2033 (a)		4 378	4 370	0,32
Total Espagne			4 820	0,35
SUÈDE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement suédois				
0,125 % éch. 01/06/2026	SEK	47 526	4 610	0,34
0,125 % éch. 01/12/2027		5 070	488	0,04
1,000 % éch. 01/06/2025		61 232	6 079	0,44
Total Suède			11 177	0,82
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
NatWest Group PLC				
4,519 % éch. 25/06/2024	$	1 000	991	0,07
6,274 % éch. 25/06/2024		1 600	1 601	0,12
			2 592	0,19
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES				
Alba PLC				
3,714 % éch. 17/03/2039	£	867	983	0,07
Atlas Funding PLC				
3,894 % éch. 25/07/2058		2 206	2 634	0,19
Canada Square Funding PLC				
3,735 % éch. 17/01/2059		3 999	4 625	0,34
4,205 % éch. 17/06/2058		2 030	2 351	0,17
4,375 % éch. 17/06/2058		1 691	1 995	0,15
Canterbury Finance				
3,985 % éch. 16/05/2058		1 589	1 883	0,14

Tableau des investissements Fonds Global Low Duration Real Return Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Eurosail PLC			
2,155 % éch. 13/03/2045	€ 950	$ 994	0,07
2,240 % éch. 10/06/2044	1 012	1 061	0,08
2,240 % éch. 10/09/2044	1 277	1 331	0,10
3,661 % éch. 13/03/2045	£ 1 179	1 394	0,10
Great Hall Mortgages PLC			
3,675 % éch. 18/03/2039	27	32	0,00
3,695 % éch. 18/06/2038	726	861	0,06
London Wall Mortgage Capital PLC			
4,040 % éch. 15/05/2052	1 074	1 249	0,09
Mortimer BTL PLC			
4,507 % éch. 21/06/2052	1 710	2 050	0,15
Polaris PLC			
4,232 % éch. 23/10/2059	2 871	3 377	0,25
4,682 % éch. 27/05/2057	749	898	0,07
Precise Mortgage Funding PLC			
4,265 % éch. 16/10/2056	307	364	0,03
4,587 % éch. 12/12/2055	1 627	1 942	0,14
RMAC PLC			
4,206 % éch. 12/06/2046	1 515	1 813	0,13
RMAC Securities PLC			
3,656 % éch. 12/06/2044	1 643	1 847	0,14
Rochester Financing PLC			
4,126 % éch. 18/12/2044	3 233	3 750	0,27
Stratton BTL Mortgage Funding PLC			
3,656 % éch. 20/01/2054	4 451	5 225	0,38
Stratton Mortgage Funding PLC			
4,287 % éch. 12/03/2052	817	979	0,07
Towd Point Mortgage Funding PLC			
3,826 % éch. 20/07/2045	2 485	2 957	0,22
4,471 % éch. 20/02/2054	626	750	0,06
Tower Bridge Funding PLC			
4,051 % éch. 20/11/2063	2 987	3 524	0,26
4,151 % éch. 20/12/2063	1 475	1 731	0,13
Tudor Rose Mortgages			
4,031 % éch. 20/06/2048	1 860	2 206	0,16
Twin Bridges PLC			
4,386 % éch. 12/09/2050	1 593	1 912	0,14
4,637 % éch. 12/12/2054	2 281	2 732	0,20
		59 450	4,36
ÉMISSIONS SOUVERAINES			
Bon du Trésor britannique			
0,125 % éch. 22/03/2024 (a)	41 756	51 062	3,74
0,125 % éch. 22/03/2026 (a)	34 732	42 173	3,09
0,125 % éch. 22/11/2036 (a)	1 095	1 275	0,09
0,125 % éch. 22/11/2056 (a)	529	572	0,04
0,625 % éch. 22/11/2042 (a)	2 345	2 912	0,21
0,625 % éch. 22/10/2050	£ 1 900	$ 1 022	0,08
1,250 % éch. 22/11/2027 (a)	29 528	37 599	2,76
		136 615	10,01
Total Royaume-Uni		198 657	14,56
ÉTATS-UNIS			
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS			
Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates			
5,289 % éch. 25/10/2034	$ 518	513	0,04
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
3,353 % éch. 25/03/2036	60	59	0,00
Fremont Home Loan Trust			
5,124 % éch. 25/07/2035	7	7	0,00
Renaissance Home Equity Loan Trust			
5,329 % éch. 25/05/2034	2 028	1 841	0,13
Structured Asset Investment Loan Trust			
5,339 % éch. 25/10/2033	804	775	0,06
Structured Asset Securities Corp.			
5,094 % éch. 25/02/2035	1 487	1 449	0,11
		4 644	0,34
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
Nissan Motor Acceptance Co. LLC			
3,450 % éch. 15/03/2023	100	100	0,01
Sabine Pass Liquefaction LLC			
5,750 % éch. 15/05/2024	200	200	0,01
		300	0,02
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES			
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
4,929 % éch. 25/08/2036	147	146	0,01
5,029 % éch. 25/10/2028	7	6	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust			
4,819 % éch. 19/04/2035	305	276	0,02
4,839 % éch. 19/07/2035	54	47	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
4,969 % éch. 25/07/2045	419	384	0,03
5,029 % éch. 25/07/2045	80	74	0,01
		933	0,07
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Ginnie Mae			
3,858 % éch. 20/08/2068	1 126	1 095	0,08
4,542 % éch. 20/08/2066	255	254	0,02
4,626 % éch. 20/08/2072	5 087	5 071	0,37
4,726 % éch. 20/10/2072	5 013	4 936	0,36
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,500 % éch. 01/01/2053	$ 500	$ 423	0,03
3,000 % éch. 01/02/2053	16 300	14 322	1,05
4,000 % éch. 01/02/2053	30 500	28 615	2,10
4,500 % éch. 01/02/2053	16 700	16 077	1,18
		70 793	5,19
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (a)			
0,125 % éch. 15/07/2024	18 824	18 219	1,34
0,125 % éch. 15/10/2024 (c)	80 600	77 632	5,69
0,125 % éch. 15/04/2025	53 723	51 209	3,75
0,125 % éch. 15/10/2025	70 167	66 700	4,89
0,125 % éch. 15/04/2026	55 936	52 603	3,86
0,125 % éch. 15/07/2026 (c)	82 287	77 564	5,68
0,125 % éch. 15/10/2026 (c)	68 916	64 620	4,74
0,125 % éch. 15/04/2027 (d)	22 057	20 564	1,51
0,125 % éch. 15/01/2030	2 200	1 978	0,14
0,125 % éch. 15/07/2030	7 206	6 456	0,47
0,125 % éch. 15/07/2031	4 758	4 208	0,31
0,125 % éch. 15/01/2032	1 612	1 414	0,10
0,125 % éch. 15/02/2051	343	221	0,02
0,250 % éch. 15/01/2025	55 480	53 228	3,90
0,250 % éch. 15/02/2050	464	313	0,02
0,375 % éch. 15/07/2023	15 365	15 183	1,11
0,375 % éch. 15/07/2025	61 318	58 903	4,32
0,375 % éch. 15/01/2027	60 690	57 252	4,20
0,375 % éch. 15/07/2027	41 659	39 278	2,88
0,500 % éch. 15/04/2024	58 340	56 739	4,16
0,500 % éch. 15/01/2028 (c)	72 238	67 962	4,98
0,625 % éch. 15/04/2023	30 722	30 409	2,23
0,625 % éch. 15/01/2024	44 855	43 906	3,22
0,625 % éch. 15/01/2026 (d)	61 235	58 796	4,31
0,750 % éch. 15/02/2045	1 898	1 537	0,11
0,875 % éch. 15/02/2047	741	608	0,04
1,375 % éch. 15/02/2044	1 151	1 070	0,08
1,625 % éch. 15/10/2027	19 514	19 500	1,43
2,125 % éch. 15/02/2041	816	866	0,06
		948 938	69,55
Total États-Unis		1 025 608	75,17
Total des valeurs mobilières		**$ 1 661 693**	**121,79**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (b)	1 248 093	12 424	0,91
Total Fonds d'investissement		**$ 12 424**	**0,91**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux directeur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Accords de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	en % de l'actif net
FICC	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 1 053	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 29/06/2023	$ (1 074)	$ 1 053	$ 1 053	0,08
Total des contrats de mise en pension						**$ (1 074)**	**$ 1 053**	**$ 1 053**	**0,08**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois mars	Long	03/2023	411	$ (3 600)	(0,26)
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars	Court	03/2023	16	71	0,01
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	29	23	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Long	03/2023	163	(715)	(0,05)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	Court	03/2023	226	1 951	0,14

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	421	$ 916	0,07
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	Court	03/2023	79	1 864	0,14
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars	Court	03/2023	65	617	0,04
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars	Court	03/2023	461	670	0,05
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Court	03/2023	29	607	0,04
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	29	(148)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Long	03/2023	179	(48)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Court	03/2023	29	38	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	228	(137)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Long	03/2023	9	(8)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	695	1 445	0,10
				$ 3 546	0,26
Total des instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé				**$ 3 546**	**0,26**

[1] Option Future style (Style futur).

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
General Electric Co.	1,000 %	20/12/2023	$ 500	$ (4)	0,00

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance		Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
À payer[3]	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	2,000 %	15/03/2033	£	3 000	$ (435)	(0,03)
À recevoir[3]	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053		2 300	21	0,00
À payer	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	3,500	12/12/2027		10 100	(107)	(0,01)
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,000	16/06/2029	¥	3 582 000	493	0,04
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,435	20/06/2029		1 418 000	161	0,01
À recevoir[3]	LIBOR USD à 3 mois	1,840	21/11/2028	$	11 700	839	0,06
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,880	25/01/2052		4 300	(1 248)	(0,09)
À payer[3]	LIBOR USD à 3 mois	1,888	21/11/2053		2 400	(585)	(0,04)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,190	04/11/2052	€	2 100	932	0,07
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,195	04/11/2052		2 200	1 109	0,08
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,197	08/11/2052		4 000	1 768	0,13
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024		2 200	(95)	(0,01)
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	0,830	09/12/2052		7 000	208	0,02
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2025		53 700	1 236	0,09
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028		16 800	(1 310)	(0,10)
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053		1 800	65	0,01
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033		28 300	(345)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	12/12/2032		10 200	(366)	(0,03)
À recevoir	CPTFEMU	1,005	15/02/2025		18 100	1 762	0,13
À payer	CPTFEMU	1,355	15/02/2050		1 200	(72)	(0,01)
À payer	CPTFEMU	1,375	15/02/2040		1 600	(159)	(0,01)
À recevoir	CPTFEMU	1,380	15/03/2031		4 800	508	0,04
À recevoir	CPTFEMU	1,500	15/07/2031		7 040	789	0,06
À payer	CPTFEMU	1,946	15/03/2048		800	(156)	(0,01)
À recevoir	CPTFEMU	2,359	15/08/2030		1 500	62	0,00
À payer	CPTFEMU	2,421	15/05/2052		330	(39)	0,00
À recevoir	CPTFEMU	2,470	15/07/2032		1 600	61	0,00
À payer	CPTFEMU	2,488	15/05/2037		2 290	(136)	(0,01)
À recevoir	CPTFEMU	2,550	15/04/2052		300	30	0,00
À recevoir	CPTFEMU	2,570	15/06/2032		1 200	39	0,00
À payer	CPTFEMU	2,580	15/03/2052		1 400	(117)	(0,01)
À payer	CPTFEMU	2,590	15/12/2052		1 700	(19)	0,00
À recevoir	CPTFEMU	2,600	15/05/2032		3 000	108	0,01
À recevoir	CPTFEMU	2,720	15/06/2032		1 800	42	0,00
À recevoir	CPTFEMU	2,975	15/08/2027		19 700	186	0,01
À recevoir	CPTFEMU	3,000	15/05/2027		5 400	126	0,01
À recevoir	CPTFEMU	3,130	15/05/2027		100	3	0,00
À payer	CPTFEMU	3,520	15/09/2024		5 200	(77)	(0,01)
À payer	CPTFEMU	3,720	15/09/2024		3 300	(36)	0,00
À payer	CPTFEMU	3,850	15/09/2024		7 700	(80)	(0,01)
À recevoir	CPURNSA	1,794	24/08/2027	$	6 700	160	0,01
À recevoir	CPURNSA	1,798	25/08/2027		3 400	81	0,01
À payer	CPURNSA	1,883	20/11/2029		7 400	(179)	(0,01)
À recevoir	CPURNSA	1,890	27/08/2027		6 500	159	0,01
À payer	CPURNSA	1,954	03/06/2029		4 700	(119)	(0,01)
À payer	CPURNSA	1,998	25/07/2029		4 300	(112)	(0,01)
À recevoir	CPURNSA	2,210	05/02/2023		17 550	700	0,05
À recevoir	CPURNSA	2,220	13/04/2023		7 440	270	0,02

Tableau des investissements Fonds Global Low Duration Real Return Fund (suite)

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
À recevoir	CPURNSA	2,263 %	27/04/2023	$ 60	$ 2	0,00
À recevoir	CPURNSA	2,263	09/05/2023	5 230	184	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,281	10/05/2023	6 064	224	0,02
À recevoir	CPURNSA	2,311	24/02/2031	6 600	186	0,01
À payer	CPURNSA	2,335	05/02/2028	6 110	(188)	(0,01)
À payer	CPURNSA	2,353	09/05/2028	960	(30)	0,00
À payer	CPURNSA	2,364	10/05/2028	7 960	(246)	(0,02)
À payer	CPURNSA	2,379	09/07/2028	1 900	(59)	0,00
À recevoir	CPURNSA	2,419	05/03/2026	400	11	0,00
À recevoir	CPURNSA	2,690	01/06/2026	1 300	36	0,00
À recevoir	CPURNSA	2,703	25/05/2026	2 450	68	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,768	13/05/2026	3 500	98	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,813	14/05/2026	1 600	45	0,00
À payer	CPURNSA	5,000	03/03/2023	16 000	(231)	(0,02)
À payer	FRCPXTOB	1,280	15/11/2034	€ 1 700	(227)	(0,02)
À payer	FRCPXTOB	1,410	15/11/2039	2 000	(327)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,330	15/01/2025	£ 400	(45)	0,00
À payer	IPC Royaume-Uni	3,346	15/05/2030	550	(27)	0,00
À payer	IPC Royaume-Uni	3,530	15/10/2031	7 260	(488)	(0,04)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,566	15/03/2036	1 400	2	0,00
À payer	IPC Royaume-Uni	3,850	15/09/2024	2 500	(315)	(0,02)
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,125	15/09/2032	480	6	0,00
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,130	15/09/2032	2 120	25	0,00
À payer	IPC Royaume-Uni	4,288	15/02/2032	2 200	(28)	0,00
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,480	15/09/2023	1 300	168	0,01
À recevoir	IPC Royaume-Uni	5,330	15/06/2024	8 800	260	0,02
À recevoir	IPC Royaume-Uni	6,440	15/05/2024	1 500	86	0,01
À recevoir	IPC Royaume-Uni	6,600	15/05/2024	2 200	119	0,01
					$ 5 435	0,40
Total des instruments financiers dérivés compensés					**$ 5 431**	**0,40**

(1) Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(2) Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, tel que défini par les termes de ce contrat de swap précis.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Voir note 2, Transactions sur titres et revenus sur investissements, dans les Notes relatives aux États financiers pour plus d'informations.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Coût	Juste valeur	en % de l'actif net
BPS	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,000 %	15/03/2023	1 400	$ 157	$ 759	0,06
BRC	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 2 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,410	02/02/2023	59 900	299	0	0,00
CBK	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 2 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,720	23/02/2023	11 300	62	0	0,00
DUB	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,237	17/11/2023	8 700	540	1 934	0,14
GLM	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,200	26/04/2023	10 000	107	6	0,00
JPM	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 2 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,710	25/01/2023	12 100	74	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,000	15/03/2023	1 800	198	975	0,07
MYC	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 2 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,428	31/01/2023	59 500	304	0	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,200	31/05/2023	28 400	341	34	0,00
							$ 2 082	$ 3 708	0,27

OPTIONS VENDUES

OPTIONS PLAFONNÉES SUR L'INFLATION

Contrepartie	Description	Indice initial	Taux variable	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Prime	Juste valeur	en % de l'actif net
GLM	Taux plafond - CPALEMU hors cote	100,152 $	Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 3,000 %] ou 0	22/06/2035	1 500	$ (69)	$ (76)	(0,01)
JPM	Taux plafond - CPURNSA hors cote	233,916 $	Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 4,000 %] ou 0	22/04/2024	1 000	(7)	0	0,00
	Taux plafond - CPURNSA hors cote	234,781 $	Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 4,000 %] ou 0	16/05/2024	100	(1)	0	0,00
						$ (77)	$ (76)	(0,01)

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	en % de l'actif net
BPS	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,175 %	15/03/2023	4 200	$ (154)	$ (1 291)	(0,09)
BRC	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,558	02/02/2023	13 100	(300)	0	0,00
CBK	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,736	23/02/2023	2 700	(67)	0	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À recevoir	4,290	17/01/2023	6 400	(269)	(354)	(0,03)
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À payer	4,290	17/01/2023	6 400	(269)	(15)	0,00
DUB	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,340	17/11/2023	43 000	(542)	(2 787)	(0,20)
GLM	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,350	26/04/2023	5 500	(109)	(9)	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547	07/03/2023	4 200	(92)	(9)	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	4 200	(92)	(265)	(0,02)
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	11 100	(121)	(28)	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	11 100	(156)	(363)	(0,03)
GST	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,950	05/01/2023	13 200	(342)	(4)	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,950	05/01/2023	13 200	(342)	(299)	(0,02)
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	3,230	18/01/2023	7 600	(204)	(86)	(0,01)
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,230	18/01/2023	7 600	(204)	(65)	(0,01)
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À recevoir	4,670	10/01/2023	6 600	(262)	(596)	(0,04)
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À payer	4,670	10/01/2023	6 600	(262)	(1)	0,00
JPM	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,785	25/01/2023	2 800	(78)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,175	15/03/2023	5 400	(194)	(1 660)	(0,12)
MYC	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,579	31/01/2023	13 000	(304)	0	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,350	31/05/2023	15 600	(340)	(46)	0,00
							$ (4 703)	$ (7 878)	(0,57)

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE DE CRÉDIT SUR INDICES DE CRÉDIT – VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	en % de l'actif net
GST	Indice CMBX.NA.AAA.8	0,500 %	17/10/2057	$ 600	$ (40)	$ 41	$ 1	0,00
SAL	Indice CMBX.NA.AAA.12	0,500	17/08/2061	1 400	(3)	(8)	(11)	0,00
UAG	Indice CMBX.NA.AAA.9	0,500	17/09/2058	894	(79)	78	(1)	0,00
					$ (122)	$ 111	$ (11)	0,00

(1) Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(2) Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, tel que défini par les termes de ce contrat de swap précis.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	AUD	8 374	$	5 672	$ 0	$ (9)	$ (9)	0,00
	01/2023	£	4 341		5 338	115	0	115	0,01
	01/2023	¥	131 600		998	0	0	0	0,00
	01/2023	$	1 049	£	860	0	(15)	(15)	0,00
BPS	01/2023		1 793	€	1 682	3	0	3	0,00
	03/2023		205	PEN	796	3	0	3	0,00
BRC	01/2023	£	8 612	$	10 575	214	0	214	0,02
	01/2023	SEK	102 229		9 761	0	(54)	(54)	0,00
	01/2023	$	1 458	€	1 371	6	0	6	0,00
CBK	01/2023	CHF	514	$	544	0	(12)	(12)	0,00
	01/2023	€	971		1 035	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	¥	136 300		989	0	(45)	(45)	0,00
	01/2023	SEK	1 900		182	0	0	0	0,00
	01/2023	$	774	DKK	5 390	0	0	0	0,00
	01/2023		1 078	PEN	4 265	38	0	38	0,00
	02/2023	PEN	21 397	$	5 331	0	(260)	(260)	(0,02)
DUB	01/2023	DKK	158 014		22 271	0	(417)	(417)	(0,03)
GLM	05/2023	$	806	PEN	3 206	26	0	26	0,00
JPM	01/2023	£	121 578	$	146 808	539	0	539	0,04
MBC	01/2023	AUD	311		209	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	CAD	3 093		2 306	23	0	23	0,00
	01/2023	DKK	142 891		20 185	0	(332)	(332)	(0,03)
	01/2023	€	250 359		262 444	0	(4 866)	(4 866)	(0,36)
	01/2023	¥	1 400 580		10 172	0	(450)	(450)	(0,03)
MYI	01/2023	AUD	9 868		6 627	0	(67)	(67)	(0,01)
	01/2023	€	132		141	0	0	0	0,00
	01/2023	£	156		188	0	0	0	0,00
	01/2023	¥	6 684 532		48 758	0	(1 938)	(1 938)	(0,14)
	01/2023	$	397	€	373	2	0	2	0,00
	01/2023		446	£	370	0	(1)	(1)	0,00
RBC	01/2023	AUD	114	$	76	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	£	27 355		33 229	318	0	318	0,02

Tableau des investissements Fonds Global Low Duration Real Return Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
SCX	01/2023	AUD 662	$ 446	$ 0	$ (3)	$ (3)	0,00
	01/2023	¥ 860 800	6 354	0	(175)	(175)	(0,01)
	01/2023	NZD 11 177	6 962	0	(108)	(108)	(0,01)
	01/2023	$ 72	PEN 278	1	0	1	0,00
	03/2023	118	455	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	SEK 6 522	$ 623	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	$ 850	£ 700	0	(7)	(7)	0,00
				$ 1 288	$ (8 767)	$ (7 479)	(0,55)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 11 256	CHF 10 648	$ 260	$ 0	$ 260	0,02
BRC	01/2023	7	7	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	19 615	18 529	426	0	426	0,03
JPM	01/2023	CHF 1 428	$ 1 546	2	0	2	0,00
MBC	01/2023	$ 11	CHF 10	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	CHF 50	$ 54	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 254	CHF 240	5	0	5	0,00
SCX	01/2023	CHF 5 067	$ 5 487	7	0	7	0,00
	01/2023	$ 2	CHF 2	0	0	0	0,00
				$ 700	$ 0	$ 700	0,05

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de Capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de Distribution et E en EUR (couverte) de Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
AZD	01/2023	$ 34 688	€ 32 825	$ 360	$ 0	$ 360	0,03
BOA	01/2023	34 740	32 939	430	0	430	0,03
BPS	01/2023	€ 1 558	$ 1 662	0	(1)	(1)	0,00
CBK	01/2023	13 620	14 519	0	(23)	(23)	0,00
	01/2023	$ 216 030	€ 208 225	6 292	0	6 292	0,46
MBC	01/2023	€ 6 819	$ 7 263	0	(18)	(18)	0,00
	01/2023	$ 274 079	€ 261 333	4 948	0	4 948	0,36
SCX	01/2023	208 642	200 453	5 383	0	5 383	0,39
				$ 17 413	$ (42)	$ 17 371	1,27

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de Capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 660	$ 811	$ 18	$ 0	$ 18	0,00
	01/2023	$ 2 609	£ 2 141	0	(33)	(33)	0,00
BPS	01/2023	1 096	908	0	(3)	(3)	0,00
BRC	01/2023	£ 334	$ 403	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 131	£ 109	0	0	0	0,00
JPM	01/2023	46 166	38 232	0	(170)	(170)	(0,01)
MBC	01/2023	£ 1 303	$ 1 592	24	0	24	0,00
	01/2023	$ 46 630	£ 38 915	201	(13)	188	0,01
MYI	01/2023	2 446	1 994	0	(47)	(47)	0,00
TOR	01/2023	46 001	38 261	31	0	31	0,00
UAG	01/2023	1 142	925	0	(29)	(29)	0,00
				$ 274	$ (295)	$ (21)	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
AZD	01/2023	$ 32 941	SGD 45 206	$ 769	$ 0	$ 769	0,05
BOA	01/2023	81 079	111 273	1 899	0	1 899	0,14
GLM	01/2023	110 794	151 659	2 301	0	2 301	0,17
RYL	01/2023	32 937	45 206	773	0	773	0,06
				$ 5 742	$ 0	$ 5 742	0,42

Total des instruments financiers dérivés hors cote	**$ 12 056**	**0,88**
Total des investissements	**$ 1 696 203**	**124,32**
Autres actifs et passifs courants	**$ (331 828)**	**(24,32)**
Actifs nets	**$ 1 364 375**	**100,00**

ANNEXES À L'ÉTAT DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

(a) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(b) Affilié au Fonds.

(c) Des titres d'une juste valeur globale de 183 180 $ (31 décembre 2021 : 0 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

(d) Des titres d'une juste valeur globale de 79 359 $ (31 décembre 2021 : 251 028 $) ont été nantis ou livrés en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 286 $ (31 décembre 2021 : 390 $) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de transactions à terme au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 13 037 $ (31 décembre 2021 : 11 071 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 5 380 $ (31 décembre 2021 : 1 380 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Titres cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 0	$ 1 661 693	$ 0	$ 1 661 693
Fonds d'investissement	12 424	0	0	12 424
Contrats de mise en pension	0	1 053	0	1 053
Instruments financiers dérivés[3]	2 256	18 777	0	21 033
Totaux	**$ 14 680**	**$ 1 681 523**	**$ 0**	**$ 1 696 203**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur les marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 0	$ 1 420 625	$ 0	$ 1 420 625
Fonds d'investissement	12 363	0	0	12 363
Contrats de mise en pension	0	1 138	0	1 138
Instruments financiers dérivés[3]	3 585	4 864	0	8 449
Totaux	**$ 15 948**	**$ 1 426 627**	**$ 0**	**$ 1 442 575**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	en % de l'actif net
CIB	4,140 %	13/12/2022	04/01/2023	$ (6 901)	$ (6 916)	(0,51)
	4,370	08/12/2022	05/01/2023	(88 626)	(88 885)	(6,51)
	4,400	04/01/2023	19/01/2023	(6 868)	(6 867)	(0,50)
	4,400	05/01/2023	19/01/2023	(87 964)	(87 964)	(6,45)
DEU	4,450	14/12/2022	11/01/2023	(70 923)	(71 081)	(5,21)
Total des contrats de prise en pension					**$ (261 713)**	**(19,18)**

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur des opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos.	en % de l'actif net
BRC	4,180 %	03/11/2022	05/01/2023	$ (58 420)	$ (58 827)	(4,31)
	4,250	17/11/2022	12/01/2023	(10 690)	(10 748)	(0,79)
TDM	4,350	05/12/2022	05/01/2023	(9 990)	(10 024)	(0,73)
Opérations de financement de vente et rachat dos-à-dos					**$ (79 599)**	**(5,83)**

(1) Le montant à payer sur opération par vente et rachat dos-à-dos comprend 37 $ de baisse de prix différée.

Garantie (reçue)/nantie d'instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Juste valeur totale des dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ 1 129	$ (820)	$ 309	$ S/O	$ S/O	$ S/O
BOA	2 665	(2 510)	155	573	(640)	(67)
BPS	(530)	450	(80)	1 279	(1 130)	149
BRC	166	0	166	430	(350)	80
CBK	6 045	(6 000)	45	286	(280)	6
DUB	(1 270)	1 230	(40)	(7)	0	(7)
GLM	1 583	(1 500)	83	(116)	0	(116)
GST	(1 050)	1 130	80	4	0	4
HUS	S/O	S/O	S/O	124	0	124
JPM	(314)	640	326	(22)	0	(22)
MBC	(485)	340	(145)	S/O	S/O	S/O
MYC	(12)	30	18	(58)	(170)	(228)
MYI	(2 046)	1 530	(516)	1 358	(1 530)	(172)
RBC	317	(280)	37	2 086	(1 670)	416
RYL	773	(450)	323	S/O	S/O	S/O
SAL	(11)	10	(1)	(23)	0	(23)
SCX	5 105	(4 920)	185	(1 681)	1 380	(301)
TOR	31	(60)	(29)	3 026	(2 080)	946
UAG	(40)	20	(20)	750	(320)	430

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Ce qui suit est une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières négociables admises à la cote sur une Bourse officielle	114,97	106,67
Valeurs mobilières négociables négociées sur un autre marché réglementé	6,69	11,25
Autres valeurs mobilières négociables	0,13	0,56
Fonds d'investissement	0,91	1,03
Contrats de mise en pension	0,08	0,09
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,26	0,19
Instruments financiers dérivés compensés	0,40	(0,15)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,88	0,67
Contrats de prise en pension	(19,18)	S/O
Opérations de financement de vente et rachat dos-à-dos	(5,83)	(20,92)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Australie	1,01	0,99
Canada	0,16	0,20
Îles Caïmans	0,55	0,19
Danemark	3,10	9,55
France	5,15	9,96
Allemagne	4,63	S/O
Guernesey, îles Anglo-Normandes	S/O	0,05
Irlande	3,76	1,32
Italie	6,49	9,33
Japon	5,03	5,09
Luxembourg	0,17	0,01
Pays-Bas	0,19	0,35
Nouvelle-Zélande	0,52	0,65
Pérou	0,09	0,28
Slovénie	0,04	0,06
Espagne	0,35	1,79
Suède	0,82	1,05
Royaume-Uni	14,56	11,18
États-Unis	75,17	66,43
Fonds d'investissement	0,91	1,03
Contrats de mise en pension	0,08	0,09
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,26	0,19
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	0,40	(0,15)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,27	0,19
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	S/O	0,00
Options plafonnées sur l'inflation	(0,01)	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,57)	(0,22)
Options sur titres	S/O	0,00
Swaps de défaillance de crédit sur indices de crédit — vente de protection	0,00	0,00
Contrats de change à terme	(0,55)	(0,17)
Contrats de change à terme couverts	1,74	0,87
Autres actifs et passifs courants	(24,32)	(20,31)
Actifs nets	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES NÉGOCIABLES				
AUSTRALIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement australien				
0,250 % éch. 21/11/2032	AUD	30 758	$ 10 789	0,42
0,750 % éch. 21/11/2027		29 666	12 497	0,49
2,000 % éch. 21/08/2035		6 916	3 285	0,13
3,000 % éch. 20/09/2025		37 710	20 435	0,79
Total Australie			47 006	1,83
BELGIQUE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement belge				
1,400 % éch. 22/06/2053	€	2 500	1 670	0,07
CANADA				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien				
0,500 % éch. 01/12/2050 (b)	CAD	9 110	5 620	0,22
1,250 % éch. 01/12/2047 (b)		11 574	8 547	0,33
1,500 % éch. 01/12/2044 (b)		10 694	8 219	0,32
3,000 % éch. 01/12/2036 (b)		4 180	3 734	0,15
4,000 % éch. 01/12/2031 (b)		12 620	11 316	0,44
Total Canada			37 436	1,46
ÎLES CAÏMANS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
BlueMountain CLO Ltd.				
5,159 % éch. 15/07/2031	$	3 600	3 541	0,14
Catamaran CLO Ltd.				
5,425 % éch. 22/04/2030		7 362	7 257	0,28
Denali Capital CLO Ltd.				
5,129 % éch. 15/04/2031		499	491	0,02
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				
5,498 % éch. 15/09/2037		7 318	7 207	0,28
Magnetite Ltd.				
5,059 % éch. 15/04/2031		594	584	0,02
OZLM Ltd.				
5,674 % éch. 16/05/2030		5 903	5 814	0,23
Regatta Funding Ltd.				
5,149 % éch. 17/07/2031		6 000	5 898	0,23
Starwood Commercial Mortgage Trust				
5,520 % éch. 15/07/2038		3 424	3 356	0,13
Venture CLO Ltd.				
4,959 % éch. 15/07/2027		116	117	0,00
5,343 % éch. 20/01/2029		3 092	3 057	0,12
5,596 % éch. 07/09/2030		1 200	1 178	0,05
Voya CLO Ltd.				
5,094 % éch. 18/01/2029		2 114	2 092	0,08
			40 592	1,58
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Avolon Holdings Funding Ltd.				
5,500 % éch. 15/01/2023		58	58	0,00
Total îles Caïmans			40 650	1,58
DANEMARK				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
DLR Kredit A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	3 409	366	0,01
Jyske Realkredit A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050		49	5	0,00
1,000 % éch. 01/10/2053		12	1	0,00
1,500 % éch. 01/10/2050		37	4	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		8 669	963	0,04
2,500 % éch. 01/10/2047		4	1	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
0,500 % éch. 01/10/2043		28 751	3 156	0,12
0,500 % éch. 01/10/2053		0	0	0,00
1,000 % éch. 01/10/2050		3 971	397	0,02
1,500 % éch. 01/10/2053		120 104	12 805	0,50
2,500 % éch. 01/10/2047		15	2	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
0,500 % éch. 01/10/2053		86 569	8 378	0,33
1,000 % éch. 01/10/2050		174 059	17 425	0,68
1,000 % éch. 01/10/2053	DKK	26 198	$ 2 728	0,11
1,500 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,500 % éch. 01/10/2053		24 491	2 597	0,10
2,000 % éch. 01/10/2053		49 395	5 636	0,22
2,500 % éch. 01/10/2047		3	0	0,00
3,000 % éch. 01/10/2053		11 985	1 529	0,06
3,500 % éch. 01/10/2053		87 427	11 533	0,45
5,000 % éch. 01/10/2053		4 400	616	0,02
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050		19 260	2 039	0,08
1,000 % éch. 01/10/2053		49 209	4 958	0,19
1,500 % éch. 01/10/2050		51 166	5 529	0,21
1,500 % éch. 01/10/2053		109 738	11 618	0,45
2,500 % éch. 01/04/2047		9	1	0,00
			92 287	3,59
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement danois				
0,100 % éch. 15/11/2023 (b)		109 764	15 822	0,61
Total Danemark			108 109	4,20
FRANCE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement français				
0,100 % éch. 01/03/2025 (b)	€	32 700	35 202	1,37
0,100 % éch. 01/03/2026 (b)		32 845	34 696	1,35
0,100 % éch. 01/03/2028 (b)		38 695	41 341	1,61
0,100 % éch. 01/03/2029 (b)		8 118	8 408	0,32
0,100 % éch. 25/07/2031 (b)		13 572	13 871	0,54
0,100 % éch. 01/03/2032 (b)		8 259	8 693	0,34
0,100 % éch. 25/07/2036 (b)		14 495	13 880	0,54
0,100 % éch. 25/07/2038 (b)		10 559	10 103	0,39
0,700 % éch. 25/07/2030 (b)		18 157	19 505	0,76
1,850 % éch. 25/07/2027 (b)		13 654	15 517	0,60
Total France			201 216	7,82
ALLEMAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Landwirtschaftliche Rentenbank				
0,875 % éch. 15/12/2026	£	7 600	8 023	0,31
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
République d'Allemagne				
0,100 % éch. 15/04/2046 (b)	€	13 340	14 085	0,55
Total Allemagne			22 108	0,86
IRLANDE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Adagio CLO DAC				
2,098 % éch. 15/10/2031		1 700	1 768	0,07
2,158 % éch. 10/10/2031		5 800	6 033	0,23
4,541 % éch. 20/07/2036		11 600	12 388	0,48
Ares European CLO				
2,038 % éch. 15/10/2030		7 377	7 684	0,30
Ares European CLO DAC				
2,158 % éch. 15/10/2031		2 200	2 276	0,09
2,306 % éch. 20/04/2032		600	622	0,02
Armada Euro CLO DAC				
2,098 % éch. 15/07/2031		4 400	4 562	0,18
2,558 % éch. 15/11/2031		5 950	6 206	0,24
Avoca CLO DAC				
2,129 % éch. 12/01/2031		5 600	5 837	0,23
Bain Capital Euro CLO DAC				
2,236 % éch. 20/04/2032		3 800	3 964	0,15
Black Diamond CLO DAC				
2,778 % éch. 15/05/2032		7 400	7 657	0,30
Blackrock European CLO DAC				
2,946 % éch. 15/12/2032		1 900	1 970	0,08
BNPP AM Euro CLO DAC				
2,322 % éch. 22/07/2032		3 150	3 258	0,13
Bosphorus CLO DAC				
2,866 % éch. 15/12/2030		2 992	3 114	0,12
Cairn CLO DAC				
2,158 % éch. 15/10/2031		4 500	4 701	0,18
2,178 % éch. 30/04/2031		3 454	3 595	0,14
2,688 % éch. 20/10/2028		700	733	0,03
Carlyle Euro CLO DAC				
2,078 % éch. 15/01/2031	€	4 098	$ 4 268	0,17
2,428 % éch. 15/08/2030		3 189	3 322	0,13
2,688 % éch. 15/08/2032		5 400	5 598	0,22
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC				
2,128 % éch. 15/07/2030		998	1 037	0,04
Contego CLO DAC				
2,142 % éch. 23/01/2030		1 098	1 142	0,04
CVC Cordatus Loan Fund DAC				
2,278 % éch. 27/01/2031		998	1 044	0,04
2,676 % éch. 15/09/2031		2 800	2 908	0,11
Dryden Euro CLO DAC				
2,038 % éch. 15/04/2033		4 200	4 349	0,17
2,622 % éch. 15/05/2034		2 500	2 593	0,10
Euro-Galaxy CLO DAC				
2,122 % éch. 24/04/2034		5 600	5 797	0,23
Harvest CLO DAC				
1,040 % éch. 15/07/2031		1 000	964	0,04
2,136 % éch. 20/10/2031		2 200	2 280	0,09
2,138 % éch. 15/07/2031		7 400	7 627	0,30
2,228 % éch. 15/01/2032		3 700	3 826	0,15
2,433 % éch. 18/11/2029		784	826	0,03
Jubilee CLO DAC				
1,978 % éch. 15/04/2030		600	627	0,02
2,028 % éch. 15/04/2031		1 700	1 754	0,07
2,846 % éch. 15/12/2029		473	496	0,02
Laurelin DAC				
2,176 % éch. 20/10/2031		3 800	3 932	0,15
Madison Park Euro Funding DAC				
2,178 % éch. 15/07/2032		7 300	7 549	0,29
Man GLG Euro CLO DAC				
2,058 % éch. 15/10/2030		3 379	3 523	0,14
2,248 % éch. 15/01/2030		514	537	0,02
Oak Hill European Credit Partners DAC				
2,196 % éch. 20/10/2031		1 900	1 968	0,08
OCP Euro CLO DAC				
2,382 % éch. 22/09/2034		7 300	7 572	0,29
Palmer Square European Loan Funding DAC				
2,098 % éch. 15/10/2031		4 205	4 352	0,17
2,108 % éch. 15/07/2031		2 278	2 367	0,09
Purple Finance CLO DAC				
2,343 % éch. 25/01/2031		1 646	1 720	0,07
Segovia European CLO DAC				
2,173 % éch. 18/01/2031		979	1 026	0,04
2,336 % éch. 20/07/2032		6 400	6 614	0,26
Tikehau CLO DAC				
2,596 % éch. 04/08/2034		3 500	3 626	0,14
Toro European CLO DAC				
2,572 % éch. 15/02/2034		10 300	10 602	0,41
			182 214	7,09
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES				
European Loan Conduit DAC				
2,803 % éch. 17/02/2030		2 445	2 495	0,09
Glenbeigh Issuer DAC				
2,875 % éch. 24/06/2050		13 594	14 096	0,55
Primrose Residential DAC				
2,644 % éch. 24/03/2061		7 658	7 982	0,31
Shamrock Residential DAC				
2,744 % éch. 24/12/2059		4 914	5 163	0,20
3,144 % éch. 24/02/2071		7 340	7 652	0,30
			37 388	1,45
Total Irlande			219 602	8,54
ITALIE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
0,400 % éch. 15/05/2030 (b)		25 773	24 083	0,94
0,450 % éch. 22/05/2023 (b)		16 318	17 321	0,67
1,250 % éch. 15/09/2032 (b)		9 148	8 840	0,34
1,300 % éch. 15/05/2028 (b)(d)		57 642	59 489	2,31
1,400 % éch. 26/05/2025 (b)		68 731	72 418	2,82
2,550 % éch. 15/09/2041 (b)		16 758	18 165	0,71
Total Italie			200 316	7,79

Tableau des investissements Fonds Global Real Return Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
JAPON				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement japonais				
0,005 % éch. 10/03/2031 (b)	¥	949 803	$ 7 461	0,29
0,100 % éch. 10/03/2025 (b)		358 700	2 787	0,11
0,100 % éch. 10/03/2026 (b)		3 492 763	27 411	1,07
0,100 % éch. 10/03/2028 (b)		3 324 923	26 069	1,01
0,100 % éch. 10/03/2029 (b)		5 853 656	46 050	1,79
Total Japon			109 778	4,27
LUXEMBOURG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
SES S.A.				
3,600 % éch. 04/04/2023	$	500	497	0,02
PAYS-BAS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Grosvenor Place CLO BV				
2,325 % éch. 30/10/2029	€	921	972	0,04
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES				
Eurosail BV				
2,878 % éch. 17/10/2040		1 409	1 497	0,06
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
BNG Bank NV				
0,500 % éch. 21/12/2026	£	7 700	7 942	0,31
Nederlandse Waterschapsbank NV				
0,875 % éch. 30/09/2026		7 500	7 928	0,30
			15 870	0,61
Total Pays-Bas			18 339	0,71
NOUVELLE-ZÉLANDE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais				
2,000 % éch. 20/09/2025	NZD	103 811	41 973	1,63
3,000 % éch. 20/09/2030		81	34	0,00
Total Nouvelle-Zélande			42 007	1,63
PÉROU				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement péruvien				
5,940 % éch. 12/02/2029	PEN	7 900	1 902	0,07
SLOVÉNIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % éch. 05/02/2030	€	1 100	974	0,04
ESPAGNE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
BBVA Consumer Auto				
0,270 % éch. 20/07/2031		904	943	0,04
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement espagnol				
0,000 % éch. 31/01/2028 (a)		7 200	6 550	0,26
0,500 % éch. 31/10/2031		600	496	0,02
0,700 % éch. 30/11/2033 (b)		17 396	17 361	0,68
1,000 % éch. 30/11/2030 (b)		2 719	2 879	0,11
1,450 % éch. 31/10/2027		13 400	13 230	0,51
2,550 % éch. 31/10/2032		2 500	2 434	0,09
			42 950	1,67
Total Espagne			43 893	1,71

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
SUÈDE				
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement suédois				
0,125 % éch. 01/06/2026	SEK	110 522	$ 10 721	0,42
0,125 % éch. 01/12/2027		16 056	1 547	0,06
0,125 % éch. 01/06/2032		54 855	5 184	0,20
1,000 % éch. 01/06/2025		123 319	12 242	0,47
Total Suède			29 694	1,15
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
NatWest Group PLC				
4,519 % éch. 25/06/2024	$	1 400	1 387	0,05
6,274 % éch. 25/06/2024		2 200	2 201	0,09
			3 588	0,14
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES				
Alba PLC				
3,714 % éch. 17/03/2039	£	2 063	2 340	0,09
Atlas Funding PLC				
3,894 % éch. 25/07/2058		4 903	5 853	0,23
Canada Square Funding PLC				
3,735 % éch. 17/01/2059		9 236	10 683	0,42
Canterbury Finance				
3,985 % éch. 16/05/2058		3 538	4 191	0,16
Eurosail PLC				
2,155 % éch. 13/03/2045	€	1 904	1 992	0,08
2,240 % éch. 10/06/2044		2 110	2 212	0,09
2,240 % éch. 10/09/2044		2 553	2 662	0,10
3,661 % éch. 13/03/2045	£	2 651	3 134	0,12
Great Hall Mortgages PLC				
3,675 % éch. 18/03/2039		36	43	0,00
3,695 % éch. 18/06/2038		28	33	0,00
London Wall Mortgage Capital PLC				
4,040 % éch. 15/05/2052		2 505	2 914	0,11
Mortimer BTL PLC				
4,507 % éch. 21/06/2052		3 793	4 549	0,18
Polaris PLC				
4,222 % éch. 23/12/2058		5 931	6 961	0,27
4,232 % éch. 23/10/2059		10 813	12 721	0,49
Precise Mortgage Funding PLC				
4,587 % éch. 12/12/2055		4 569	5 453	0,21
RMAC PLC				
4,206 % éch. 12/06/2046		3 395	4 063	0,16
Rochester Financing PLC				
4,126 % éch. 18/12/2044		7 329	8 500	0,33
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				
3,656 % éch. 20/01/2054		4 542	5 331	0,21
Stratton Mortgage Funding PLC				
4,287 % éch. 12/03/2052		1 771	2 121	0,08
Towd Point Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2045		2 552	3 011	0,12
4,071 % éch. 20/10/2051		3 356	4 013	0,16
Tower Bridge Funding PLC				
4,051 % éch. 20/11/2063		2 899	3 420	0,13
4,151 % éch. 20/12/2063		3 412	4 002	0,16
Twin Bridges PLC				
4,637 % éch. 12/12/2054		5 376	6 440	0,25
			106 642	4,15
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Bon du Trésor britannique				
0,125 % éch. 10/08/2028 (b)		34 543	41 666	1,62
0,125 % éch. 10/08/2031 (b)		18 911	22 896	0,89
0,125 % éch. 22/03/2039 (b)		7 677	8 776	0,34
0,125 % éch. 10/08/2041 (b)		10 317	11 697	0,46
0,125 % éch. 22/03/2044 (b)		19 088	21 166	0,82
0,125 % éch. 22/03/2046 (b)		6 765	7 398	0,29
0,125 % éch. 10/08/2048 (b)		1 593	1 722	0,07
0,125 % éch. 22/03/2051 (b)		16 930	18 194	0,71
0,125 % éch. 22/11/2056 (b)		10 547	11 396	0,44
0,125 % éch. 22/03/2058 (b)		13 715	14 877	0,58
0,125 % éch. 22/11/2065 (b)		9 360	10 437	0,41
0,125 % éch. 22/03/2068 (b)		13 969	15 605	0,61
0,125 % éch. 22/03/2073 (b)		2 540	2 982	0,12
0,250 % éch. 22/03/2052 (b)		18 685	20 942	0,81

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
0,375 % éch. 22/03/2062 (b)	£	17 085	$ 20 579	0,80
0,500 % éch. 22/03/2050 (b)		15 478	18 442	0,72
0,500 % éch. 22/10/2061		6 200	2 666	0,10
0,625 % éch. 22/03/2040 (b)		20 811	25 808	1,00
0,625 % éch. 22/11/2042 (b)		22 785	28 286	1,10
0,625 % éch. 22/10/2050		2 400	1 290	0,05
0,750 % éch. 22/03/2034 (b)		28 507	36 084	1,40
0,750 % éch. 22/11/2047 (b)		11 101	13 961	0,54
1,125 % éch. 22/11/2037 (b)		12 671	16 808	0,65
1,250 % éch. 22/11/2027 (b)		25 856	32 924	1,28
1,250 % éch. 22/11/2032 (b)		61 331	81 875	3,18
1,250 % éch. 22/10/2041		11 300	8 654	0,34
1,250 % éch. 22/11/2055 (b)		14 966	22 288	0,87
1,500 % éch. 22/07/2047		3 900	2 867	0,11
2,000 % éch. 26/01/2035		3 301	4 922	0,19
2,500 % éch. 17/07/2024		12 771	16 768	0,65
4,125 % éch. 22/07/2030		7 718	12 527	0,49
			556 503	21,64
Total Royaume-Uni			666 733	25,93
ÉTATS-UNIS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Accredited Mortgage Loan Trust				
4,649 % éch. 25/09/2036	$	1 565	1 536	0,06
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
5,439 % éch. 25/12/2033		1 266	1 215	0,05
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,349 % éch. 25/10/2035		1 678	1 508	0,06
AMRESCO Residential Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
5,329 % éch. 25/06/2029		9	8	0,00
Asset-Backed Funding Certificates Trust				
4,529 % éch. 25/10/2036		6 809	6 173	0,24
4,989 % éch. 25/10/2034		515	514	0,02
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
5,668 % éch. 15/04/2033		192	187	0,01
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
4,796 % éch. 25/05/2035		289	287	0,01
Carrington Mortgage Loan Trust				
4,639 % éch. 25/04/2036		12 546	10 955	0,43
CIT Mortgage Loan Trust				
5,739 % éch. 25/10/2037		123	123	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust				
4,679 % éch. 25/09/2036		481	458	0,02
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,334 % éch. 25/10/2034		919	884	0,03
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
4,794 % éch. 25/08/2036		24	24	0,00
5,079 % éch. 25/10/2035 ^		3 100	2 800	0,11
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
5,349 % éch. 25/02/2036		8 000	7 793	0,30
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
4,598 % éch. 25/01/2032		1	1	0,00
Ellington Loan Acquisition Trust				
5,489 % éch. 25/05/2037		859	825	0,03
Encore Credit Receivables Trust				
5,289 % éch. 25/01/2036		1 400	1 337	0,05
First Franklin Mortgage Loan Trust				
4,699 % éch. 25/07/2036		947	890	0,03
5,259 % éch. 25/09/2035		1 432	1 407	0,06
Home Equity Asset Trust				
5,244 % éch. 25/08/2034		60	58	0,00
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
5,029 % éch. 25/03/2036		2 538	2 486	0,10
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
4,709 % éch. 25/05/2037		274	273	0,01
Lehman XS Trust				
6,689 % éch. 25/12/2037		1 792	1 760	0,07
Massachusetts Educational Financing Authority				
5,308 % éch. 25/04/2038		46	46	0,00
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,049 % éch. 25/01/2035		1 745	1 678	0,07
New Century Home Equity Loan Trust				
5,109 % éch. 25/10/2035		851	824	0,03
5,154 % éch. 25/02/2035		2 048	1 960	0,08

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				
4,824 % éch. 25/03/2036	$	789	$ 770	0,03
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,184 % éch. 25/07/2035		59	58	0,00
Saxon Asset Securities Trust				
1,799 % éch. 25/05/2035		3 598	3 358	0,13
4,699 % éch. 25/09/2037		898	845	0,03
SLM Student Loan Trust				
5,858 % éch. 25/04/2023		88	88	0,00
			53 129	2,07
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Eversource Energy				
2,900 % éch. 01/10/2024		100	96	0,00
Lehman Brothers Holdings, Inc.				
0,000 % éch. 05/03/2010 ^	€	950	6	0,00
0,000 % éch. 05/04/2011 ^		10	0	0,00
RELX Capital, Inc.				
3,500 % éch. 16/03/2023	$	200	199	0,01
			301	0,01
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES				
Banc of America Funding Trust				
3,775 % éch. 20/01/2047		1 078	913	0,03
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,729 % éch. 25/09/2035 ^		60	37	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust				
3,871 % éch. 25/09/2037 ^		221	190	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
3,440 % éch. 25/09/2035		2	2	0,00
5,500 % éch. 25/08/2034		478	440	0,02
Countrywide Alternative Loan Trust				
6,000 % éch. 25/04/2037		879	746	0,03
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				
3,276 % éch. 30/11/2037		1 200	1 098	0,04
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				
4,919 % éch. 19/10/2045		2 583	2 138	0,08
Greenpoint Mortgage Funding Trust				
4,829 % éch. 25/06/2045		78	71	0,00
GSR Mortgage Loan Trust				
3,767 % éch. 25/09/2035		49	46	0,00
Impac CMB Trust				
5,029 % éch. 25/03/2035		1 189	1 079	0,04
JPMorgan Mortgage Trust				
3,569 % éch. 25/07/2035		183	171	0,01
Lehman XS Trust				
4,689 % éch. 25/11/2035		145	145	0,01
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				
4,392 % éch. 20/10/2029		11	11	0,00
5,178 % éch. 15/08/2032		160	143	0,01
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
5,079 % éch. 25/08/2036	$	3 768	$ 3 537	0,14
OBX Trust				
5,039 % éch. 25/06/2057		184	173	0,01
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,189 % éch. 25/04/2035		820	775	0,03
Sequoia Mortgage Trust				
5,039 % éch. 19/10/2026		5	5	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,903 % éch. 25/08/2047		1 829	1 680	0,06
3,944 % éch. 25/09/2034		303	284	0,01
Structured Asset Securities Corp.				
4,739 % éch. 25/03/2035		205	193	0,01
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
4,929 % éch. 25/12/2045		22	21	0,00
4,949 % éch. 25/11/2045		693	601	0,02
			14 499	0,56
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Fannie Mae				
2,889 % éch. 01/09/2044		22	21	0,00
4,633 % éch. 01/12/2030		1	1	0,00
Freddie Mac				
3,248 % éch. 25/10/2044		226	226	0,01
3,757 % éch. 01/09/2036		20	20	0,00
3,928 % éch. 01/10/2036		25	25	0,00
4,133 % éch. 01/07/2036		56	57	0,00
4,649 % éch. 25/08/2031		4	4	0,00
4,669 % éch. 25/09/2031		7	7	0,00
4,918 % éch. 15/12/2037		138	137	0,01
Ginnie Mae				
2,875 % éch. 20/04/2030		3	3	0,00
3,000 % éch. 20/05/2030		2	2	0,00
3,375 % éch. 20/05/2030		25	25	0,00
3,858 % éch. 20/08/2068		1 861	1 810	0,07
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
2,500 % éch. 01/01/2053		1 500	1 271	0,05
3,000 % éch. 01/02/2053		50 000	43 931	1,71
4,000 % éch. 01/02/2053		57 400	53 863	2,10
4,500 % éch. 01/02/2053		35 900	34 560	1,34
			135 963	5,29
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (b)				
0,125 % éch. 15/07/2024		27 608	26 721	1,04
0,125 % éch. 15/10/2024		25 783	24 833	0,97
0,125 % éch. 15/04/2025 (d)		95 979	91 488	3,56
0,125 % éch. 15/10/2025		24 576	23 362	0,91
0,125 % éch. 15/04/2026		54 868	51 599	2,01
0,125 % éch. 15/07/2026		36 895	34 778	1,35
0,125 % éch. 15/10/2026 (d)		43 182	40 490	1,57
0,125 % éch. 15/04/2027 (e)		10 237	9 544	0,37
0,125 % éch. 15/01/2030 (d)		74 585	67 040	2,61
0,125 % éch. 15/07/2030		$ 25 568	$ 22 909	0,89
0,125 % éch. 15/01/2031		8 585	7 630	0,30
0,125 % éch. 15/07/2031 (d)		195 101	172 529	6,72
0,125 % éch. 15/01/2032 (d)		36 440	31 945	1,24
0,125 % éch. 15/02/2051		14 203	9 161	0,36
0,125 % éch. 15/02/2052		5 031	3 263	0,13
0,250 % éch. 15/01/2025		15 726	15 087	0,59
0,250 % éch. 15/07/2029 (d)		71 926	65 887	2,56
0,250 % éch. 15/02/2050		17 037	11 506	0,45
0,375 % éch. 15/07/2023		5 378	5 314	0,21
0,375 % éch. 15/07/2025		31 538	30 296	1,18
0,375 % éch. 15/01/2027 (d)		24 375	22 994	0,89
0,375 % éch. 15/07/2027		15 738	14 839	0,58
0,500 % éch. 15/01/2028 (d)		110 807	104 247	4,05
0,625 % éch. 15/04/2023 (d)		68 834	68 132	2,65
0,625 % éch. 15/01/2024		8 266	8 092	0,31
0,625 % éch. 15/01/2026		11 086	10 644	0,41
0,625 % éch. 15/07/2032 (d)		5 538	5 077	0,20
0,625 % éch. 15/02/2043		13 971	11 284	0,44
0,750 % éch. 15/07/2028 (d)		39 126	37 289	1,45
0,750 % éch. 15/02/2042		19 912	16 684	0,65
0,750 % éch. 15/02/2045		36 051	29 188	1,13
0,875 % éch. 15/01/2029		1 912	1 822	0,07
0,875 % éch. 15/02/2047		8 517	6 991	0,27
1,000 % éch. 15/02/2046		28 912	24 583	0,96
1,000 % éch. 15/02/2048		9 553	8 050	0,31
1,000 % éch. 15/02/2049		16 223	13 577	0,53
1,375 % éch. 15/02/2044 (d)		41 642	38 712	1,50
1,625 % éch. 15/10/2027		64 980	64 934	2,52
2,000 % éch. 15/01/2026		17 073	17 056	0,66
2,125 % éch. 15/02/2040		18 391	19 483	0,76
2,125 % éch. 15/02/2041 (d)		38 602	40 927	1,59
2,375 % éch. 15/01/2025		26 541	26 568	1,03
3,625 % éch. 15/04/2028 (d)		54 129	59 019	2,29
			1 395 574	54,27
Total États-Unis			1 599 466	62,20
Total des valeurs mobilières			**$ 3 391 396**	**131,88**

	ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)	707 536	7 043	0,27
Total Fonds d'investissement		**$ 7 043**	**0,27**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux directeur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Accords de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	en % de l'actif net
FICC	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 2 245	Billet du Trésor américain 0,125 % échéance 15/05/2023	$ (2 290)	$ 2 245	$ 2 245	0,09
Total des contrats de mise en pension						**$ (2 290)**	**$ 2 245**	**$ 2 245**	**0,09**

(1) Comprend les intérêts courus.

Tableau des investissements Fonds Global Real Return Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois mars	Long	03/2023	1 299	$ (11 378)	(0,44)
Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans mars	Court	03/2023	205	197	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars	Long	03/2023	43	(195)	(0,01)
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	54	43	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Court	03/2023	797	3 215	0,12
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	Court	03/2023	393	3 393	0,13
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	36	38	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	Long	03/2023	107	(2 924)	(0,11)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars	Long	03/2023	247	(2 407)	(0,09)
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars	Court	03/2023	2 045	2 355	0,09
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Court	03/2023	26	548	0,02
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	54	(276)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Court	03/2023	78	59	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	1 449	(1 675)	(0,07)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Court	03/2023	1 481	1 512	0,06
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Long	03/2023	96	4	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	1 252	2 707	0,11
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Court	03/2023	566	2 584	0,10
				$ (2 200)	(0,09)
Total des instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé				**$ (2 200)**	**(0,09)**

[1] Option Future style (Style futur).

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
General Electric Co.	1,000 %	20/12/2023	$ 800	$ 49	0,00

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
À payer[3]	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	2,000 %	15/03/2033	£ 37 000	$ (1 669)	(0,07)
À payer[3]	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053	5 600	(264)	(0,01)
À recevoir[3]	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	2,250	15/03/2028	22 000	(487)	(0,02)
À payer	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	3,500	12/12/2027	25 800	(272)	(0,01)
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,000	16/06/2029	¥ 10 717 000	1 481	0,06
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,435	20/06/2029	3 683 000	418	0,02
À recevoir[3]	LIBOR USD à 3 mois	1,840	21/11/2028	$ 36 400	2 994	0,12
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,880	25/01/2052	13 400	(3 891)	(0,15)
À payer[3]	LIBOR USD à 3 mois	1,888	21/11/2053	7 400	(2 027)	(0,08)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,190	04/11/2052	€ 7 000	3 108	0,12
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,195	04/11/2052	7 350	3 705	0,14
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,197	08/11/2052	12 800	5 660	0,22
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	6 500	(280)	(0,01)
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	0,830	09/12/2052	13 400	398	0,01
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2025	151 800	3 504	0,14
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028	49 000	(3 824)	(0,15)
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	18 000	355	0,01
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,500	12/12/2032	26 100	(938)	(0,04)
À recevoir	CPTFEMU	1,710	15/03/2033	5 900	1 562	0,06
À recevoir	CPTFEMU	2,359	15/08/2030	25 700	888	0,03
À recevoir	CPTFEMU	2,470	15/07/2032	12 900	493	0,02
À payer	CPTFEMU	2,570	15/06/2032	1 300	14	0,00
À recevoir	CPTFEMU	2,600	15/05/2032	20 300	734	0,03
À recevoir	CPTFEMU	2,720	15/06/2032	63 300	969	0,04
À recevoir	CPTFEMU	2,975	15/08/2027	17 800	210	0,01
À payer	CPTFEMU	3,520	15/09/2024	23 800	(391)	(0,02)
À payer	CPTFEMU	3,720	15/09/2024	6 400	(70)	0,00
À payer	CPTFEMU	3,850	15/09/2024	27 600	(288)	(0,01)
À payer	CPURNSA	1,760	04/11/2029	$ 23 300	(3 437)	(0,13)
À payer	CPURNSA	1,883	20/11/2029	300	(42)	0,00
À payer	CPURNSA	1,954	03/06/2029	6 200	(806)	(0,03)
À payer	CPURNSA	1,998	25/07/2029	1 800	(223)	(0,01)
À recevoir	CPURNSA	2,210	05/02/2023	21 840	1 974	0,08

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
À recevoir	CPURNSA	2,263 %	09/05/2023	$ 6 846	$ 570	0,02
À recevoir	CPURNSA	2,311	24/02/2031	6 500	677	0,03
À recevoir	CPURNSA	2,314	26/02/2026	14 400	1 387	0,05
À payer	CPURNSA	2,364	10/05/2028	800	(68)	0,00
À payer	CPURNSA	2,370	06/06/2028	12 900	(1 098)	(0,04)
À payer	CPURNSA	2,379	09/07/2028	700	(58)	0,00
À recevoir	CPURNSA	2,573	26/08/2028	2 200	133	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,645	10/09/2028	3 600	190	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,690	01/06/2026	2 300	168	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,703	25/05/2026	8 980	656	0,02
À recevoir	CPURNSA	2,768	13/05/2026	13 900	988	0,04
À recevoir	CPURNSA	2,813	14/05/2026	20 100	1 383	0,05
À payer	IPC Royaume-Uni	3,835	15/10/2032	£ 22 800	(1 076)	(0,04)
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,140	15/10/2031	14 200	882	0,03
À payer	IPC Royaume-Uni	4,143	15/10/2032	22 800	(890)	(0,04)
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,250	15/11/2031	17 860	1 172	0,04
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,300	15/01/2032	6 000	142	0,01
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,615	15/02/2027	12 300	405	0,02
À recevoir	IPC Royaume-Uni	5,200	15/06/2024	5 500	279	0,01
À recevoir	IPC Royaume-Uni	5,330	15/06/2024	11 900	567	0,02
À recevoir	IPC Royaume-Uni	6,290	15/03/2024	5 500	412	0,02
À recevoir	IPC Royaume-Uni	6,440	15/05/2024	2 200	127	0,00
À payer	IPC Royaume-Uni	6,500	15/03/2024	26 700	(1 859)	(0,07)
À recevoir	IPC Royaume-Uni	6,600	15/05/2024	5 400	289	0,01
					$ 14 936	0,58
Total des instruments financiers dérivés compensés					**$ 14 985**	**0,58**

(1) Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(2) Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, tel que défini par les termes de ce contrat de swap précis.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Voir note 2, Transactions sur titres et revenus sur investissements, dans les Notes relatives aux États financiers pour plus d'informations.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Coût	Juste valeur	en % de l'actif net
BPS	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,000 %	15/03/2023	4 500	$ 505	$ 2 438	0,10
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,410	02/02/2023	179 700	898	0	0,00
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,720	23/02/2023	27 800	153	0	0,00
DUB	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,237	17/11/2023	27 000	1 676	6 003	0,23
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,200	26/04/2023	29 200	312	18	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,710	25/01/2023	29 500	180	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,000	15/03/2023	5 900	650	3 196	0,13
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,428	31/01/2023	179 200	915	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,200	31/05/2023	85 000	1 020	102	0,00
							$ 6 309	$ 11 757	0,46

OPTIONS VENDUES

OPTIONS PLAFONNÉES SUR L'INFLATION

Contrepartie	Description	Indice initial	Taux variable	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Prime	Juste valeur	en % de l'actif net
GLM	Taux plafond - CPALEMU hors cote	$ 100,151	Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 3,000 %] ou 0	22/06/2035	7 800	$ (356)	$ (396)	(0,02)
JPM	Taux plafond - Indice CPURNSA hors cote	$ 233,916	Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 4,000 %] ou 0	22/04/2024	37 600	(273)	0	0,00
	Taux plafond - Indice CPURNSA hors cote	$ 234,781	Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 4,000 %] ou 0	16/05/2024	3 100	(22)	0	0,00
						$ (651)	$ (396)	(0,02)

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Prime	Juste valeur	en % de l'actif net
BPS	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,175 %	15/03/2023	13 500	$ (495)	$ (4 149)	(0,16)
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,558	02/02/2023	39 300	(899)	0	0,00
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,736	23/02/2023	6 600	(163)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À recevoir	4,290	17/01/2023	14 600	(614)	(807)	(0,03)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À payer	4,290	17/01/2023	14 600	(614)	(34)	0,00

Tableau des investissements Fonds Global Real Return Fund (suite)

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	en % de l'actif net
DUB	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,340 %	17/11/2023	133 200	$ (1 678)	$ (8 635)	(0,34)
GLM	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,350	26/04/2023	16 600	(328)	(28)	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547	07/03/2023	8 300	(182)	(19)	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	8 300	(182)	(523)	(0,02)
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	9 600	(114)	(25)	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	9 600	(132)	(314)	(0,01)
GST	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,950	05/01/2023	30 500	(790)	(9)	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,950	05/01/2023	30 500	(791)	(691)	(0,03)
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	3,230	18/01/2023	19 100	(514)	(216)	(0,01)
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,230	18/01/2023	19 100	(514)	(163)	(0,01)
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À recevoir	4,670	10/01/2023	15 000	(596)	(1 355)	(0,05)
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR GBP à 6 mois	À payer	4,670	10/01/2023	15 000	(596)	(2)	0,00
JPM	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,785	25/01/2023	7 000	(194)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,175	15/03/2023	17 700	(638)	(5 440)	(0,21)
MYC	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,579	31/01/2023	39 100	(914)	0	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,350	31/05/2023	46 800	(1 020)	(138)	(0,01)
							$ (11 968)	$ (22 548)	(0,88)

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE DE CRÉDIT SUR INDICES DE CRÉDIT – VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	en % de l'actif net
GST	Indice CMBX.NA.AAA.8	0,500 %	17/10/2057	$ 12 200	$ (713)	$ 724	$ 11	0,00
SAL	Indice CMBX.NA.AAA.12	0,500	17/08/2061	2 500	(5)	(15)	(20)	0,00
					$ (718)	$ 709	$ (9)	0,00

(1) Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(2) Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, tel que défini par les termes de ce contrat de swap précis.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	£	26 304	$	32 343	$ 698	$ 0	$ 698	0,03
	01/2023	PEN	1 992		500	0	(21)	(21)	0,00
	01/2023	$	30 071	£	25 007	49	(34)	15	0,00
BOM	01/2023	CAD	16 816	$	12 523	112	0	112	0,00
BPS	01/2023	SGD	2		1	0	0	0	0,00
	03/2023	$	342	PEN	1 328	4	0	4	0,00
BRC	01/2023	SEK	276 627	$	26 413	0	(146)	(146)	(0,01)
	01/2023	$	2 201	€	2 069	8	0	8	0,00
	01/2023		1 419	£	1 161	0	(22)	(22)	0,00
CBK	01/2023	AUD	312	$	212	1	0	1	0,00
	01/2023	DKK	19 715		2 778	0	(53)	(53)	0,00
	01/2023	€	4 000		4 264	0	(7)	(7)	0,00
	01/2023	¥	321 600		2 334	0	(105)	(105)	0,00
	01/2023	NZD	66 885		41 759	0	(546)	(546)	(0,02)
	01/2023	SEK	5 850		561	0	0	0	0,00
	01/2023	$	14 736	DKK	103 680	150	0	150	0,01
	01/2023		272	PEN	1 093	14	0	14	0,00
	02/2023	PEN	16 727	$	4 194	0	(179)	(179)	(0,01)
	03/2023	$	287	PEN	1 155	14	0	14	0,00
DUB	01/2023	DKK	464 740	$	65 502	0	(1 227)	(1 227)	(0,05)
JPM	01/2023	$	2 524	DKK	18 025	64	0	64	0,00
MBC	01/2023	AUD	6 069	$	4 112	10	(15)	(5)	0,00
	01/2023	DKK	420 260		59 365	0	(977)	(977)	(0,04)
	01/2023	€	18 506		19 505	0	(254)	(254)	(0,01)
	01/2023	£	24 096		29 367	378	0	378	0,02
	01/2023	¥	3 025 134		22 094	0	(848)	(848)	(0,03)
	01/2023	$	3 794	DKK	27 130	102	0	102	0,00
	01/2023		31 097	€	29 472	370	0	370	0,02
	01/2023		1 156	£	950	0	(13)	(13)	0,00
	01/2023		1 152	¥	151 400	0	(3)	(3)	0,00
MYI	01/2023	AUD	61 303	$	41 168	0	(415)	(415)	(0,02)
	01/2023	€	102		109	0	0	0	0,00
	01/2023	£	1 046		1 264	6	0	6	0,00
	01/2023	¥	11 624 996		84 794	0	(3 371)	(3 371)	(0,13)
	01/2023	$	1 394	€	1 319	14	0	14	0,00
	01/2023		7 479	£	6 123	0	(113)	(113)	0,00
RBC	01/2023	AUD	706	$	473	0	(6)	(6)	0,00
	01/2023	£	2 839		3 463	47	0	47	0,00
	01/2023	$	850	€	800	4	0	4	0,00
	01/2023		241	£	200	0	(1)	(1)	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
SCX	01/2023	CAD	14 670	$	10 919	$ 92	$ 0	$ 92	0,00
	01/2023	€	676 967		704 621	0	(18 182)	(18 182)	(0,71)
	01/2023	$	145	PEN	555	1	0	1	0,00
	03/2023		260		1 002	1	0	1	0,00
TOR	01/2023	CAD	20 432	$	15 199	119	0	119	0,01
	01/2023	£	570 785		686 248	0	(459)	(459)	(0,02)
UAG	01/2023	SEK	17 649		1 686	0	(8)	(8)	0,00
	01/2023	$	1 456	€	1 379	17	0	17	0,00
						$ 2 275	$ (27 005)	$ (24 730)	(0,96)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de Capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de Distribution et Investisseurs en CHF (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	$	34 381	CHF	32 517	$ 787	$ 0	$ 787	0,03
BRC	01/2023		17		16	0	0	0	0,00
CBK	01/2023		59 687		56 385	1 297	0	1 297	0,05
MBC	01/2023	CHF	615	$	665	1	(2)	(1)	0,00
	01/2023	$	805	CHF	744	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01/2023	CHF	73	$	77	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01/2023		32		34	0	0	0	0,00
	01/2023	$	6 341	CHF	5 858	2	(7)	(5)	0,00
						$ 2 087	$ (11)	$ 2 076	0,08

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en USD (exposition au risque de change) de Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOM	01/2023	$	273	CAD	366	$ 0	$ (2)	$ (2)	0,00
BRC	01/2023		271	SEK	2 835	2	0	2	0,00
CBK	01/2023	DKK	583	$	82	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$	6	SEK	65	0	0	0	0,00
JPM	01/2023		10 586	£	8 766	0	(39)	(39)	0,00
MBC	01/2023		13	AUD	20	0	0	0	0,00
	01/2023		331	CAD	444	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023		147	DKK	1 050	4	0	4	0,00
	01/2023		8 930	€	8 520	167	0	167	0,01
	01/2023		507	£	416	0	(6)	(6)	0,00
	01/2023		231	¥	31 846	10	0	10	0,00
MYI	01/2023		418	AUD	623	4	0	4	0,00
	01/2023		1 102	¥	151 034	44	0	44	0,00
RBC	01/2023		5	AUD	7	0	0	0	0,00
SCX	01/2023		28		42	0	0	0	0,00
	01/2023		238	CAD	319	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023		257	NZD	412	4	0	4	0,00
UAG	01/2023		17	SEK	181	0	0	0	0,00
						$ 235	$ (54)	$ 181	0,01

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de Capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de Distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de Capitalisation et E en EUR (couverte) de Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	$	16 920	€	16 043	$ 209	$ 0	$ 209	0,01
BPS	01/2023	€	762	$	813	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	151	€	142	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	€	3 138	$	3 328	0	(23)	(23)	0,00
	01/2023	$	385 791	€	371 918	11 309	0	11 309	0,44
MBC	01/2023	€	4 053	$	4 310	0	(18)	(18)	0,00
	01/2023	$	469 755	€	447 988	8 563	0	8 563	0,33
SCX	01/2023		400 712		384 986	10 340	0	10 340	0,40
						$ 30 421	$ (42)	$ 30 379	1,18

Tableau des investissements Fonds Global Real Return Fund (suite)

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de distribution et R en GBP (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 3 967	$ 4 832	$ 60	$ 0	$ 60	0,00
	01/2023	$ 336	£ 278	0	(1)	(1)	0,00
BPS	01/2023	£ 56	$ 68	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 469	£ 389	0	(1)	(1)	0,00
BRC	01/2023	£ 1 929	$ 2 323	2	0	2	0,00
	01/2023	$ 691	£ 574	0	0	0	0,00
JPM	01/2023	105 988	87 773	0	(389)	(389)	(0,01)
MBC	01/2023	£ 54	$ 66	1	0	1	0,00
	01/2023	$ 104 774	£ 87 373	430	(87)	343	0,01
MYI	01/2023	£ 59	$ 71	1	0	1	0,00
	01/2023	$ 2 735	£ 2 225	0	(59)	(59)	0,00
RBC	01/2023	£ 4	$ 5	0	0	0	0,00
TOR	01/2023	$ 105 205	£ 87 504	70	0	70	0,00
UAG	01/2023	£ 266	$ 329	9	0	9	0,00
				$ 573	$ (537)	$ 36	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 55 938	SGD 76 768	$ 1 309	$ 0	$ 1 309	0,05
BPS	01/2023	58 636	80 410	1 328	0	1 328	0,05
GLM	01/2023	4 621	6 322	93	0	93	0,00
MBC	01/2023	58 459	79 929	1 145	0	1 145	0,05
				$ 3 875	$ 0	$ 3 875	0,15

Total des instruments financiers dérivés hors cote	**$ 621**	**0,02**
Total des investissements	**$ 3 414 090**	**132,75**
Autres actifs et passifs courants	**$ (842 228)**	**(32,75)**
Actifs nets	**$ 2 571 862**	**100,00**

ANNEXES À L'ÉTAT DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

(c) Affilié au Fonds.

(d) Des titres d'une juste valeur globale de 734 559 $ (31 décembre 2021 : 778 051 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

(e) Un titre d'une juste valeur globale de 9 544 $ (31 décembre 2021 : 336 989 $) a été nanti ou livré en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 0 $ (31 décembre 2021 : 860 $) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de transactions à terme au 31 décembre 2022.

Un titre d'une juste valeur globale de 101 $ (31 décembre 2021 : 5 677 $) et un montant en numéraire de 0 $ (31 décembre 2021 : 678 $) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 24 192 $ (31 décembre 2021 : 23 175 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 21 490 $ (31 décembre 2021 : 12 320 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur les marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 0	$ 3 391 396	$ 0	$ 3 391 396
Fonds d'investissement	7 043	0	0	7 043
Contrats de mise en pension	0	2 245	0	2 245
Instruments financiers dérivés[3]	(4 808)	18 214	0	13 406
Totaux	**$ 2 235**	**$ 3 411 855**	**$ 0**	**$ 3 414 090**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 0	$ 4 811 615	$ 0	$ 4 811 615
Fonds d'investissement	192	0	0	192
Contrats de mise en pension	0	5 680	0	5 680
Instruments financiers dérivés[3]	9 953	7 569	0	17 522
Titres vendus à découvert	0	(311)	0	(311)
Totaux	**$ 10 145**	**$ 4 824 553**	**$ 0**	**$ 4 834 698**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	en % de l'actif net
BOS	4,200 %	14/11/2022	09/01/2023	$ (14 755)	$ (14 838)	(0,58)
BRC	1,280	13/10/2022	16/01/2023	€ (2 952)	(3 159)	(0,12)
BSN	4,160	03/11/2022	04/01/2023	$ (550 793)	(554 549)	(21,56)
CIB	4,140	03/11/2022	04/01/2023	(48 625)	(48 955)	(1,90)
	4,140	01/12/2022	04/01/2023	(14 235)	(14 286)	(0,56)
	4,200	17/11/2022	11/01/2023	(35 663)	(35 850)	(1,39)
	4,370	08/12/2022	05/01/2023	(4 615)	(4 628)	(0,18)
	4,400	04/01/2023	19/01/2023	(63 423)	(63 422)	(2,47)
	4,400	05/01/2023	19/01/2023	(4 550)	(4 550)	(0,18)
GRE	4,350	07/12/2022	05/01/2023	(39 790)	(39 910)	(1,55)
	4,360	07/12/2022	05/01/2023	(11 969)	(12 005)	(0,47)
Total des contrats de prise en pension					**$ (796 152)**	**(30,96)**

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos[1]	en % de l'actif net
BOS	4,210 %	09/11/2022	09/01/2023	$ (9 459)	$ (9 519)	(0,37)
Opérations de financement de vente et rachat dos-à-dos					**$ (9 519)**	**(0,37)**

(1) Le montant à payer sur opération par vente et rachat dos-à-dos comprend 8 $ de baisse de prix différée.

Garantie (reçue)/nantie d'instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ 3 056	$ (2 990)	$ 66	$ 2 707	$ (2 720)	$ (13)
BOM	110	0	110	S/O	S/O	S/O
BPS	(381)	580	199	5 488	(4 780)	708
BRC	(156)	130	(26)	7	60	67
CBK	11 029	(10 872)	157	835	(1 050)	(215)
DUB	(3 859)	3 720	(139)	422	(280)	142
GLM	(1 194)	610	(584)	(589)	0	(589)
GSC	S/O	S/O	S/O	(6)	0	(6)
GST	(2 425)	2 410	(15)	85	0	85
HUS	S/O	S/O	S/O	729	(460)	269
JPM	(2 608)	2 180	(428)	(318)	0	(318)
MBC	8 954	(8 240)	714	S/O	S/O	S/O
MYC	(36)	90	54	(181)	(47)	(228)
MYI	(3 890)	2 910	(980)	4 565	(5 170)	(605)
RBC	44	0	44	4 250	(3 360)	890
SAL	(20)	130	110	(79)	280	201
SCX	(7 751)	7 310	(441)	8 835	(6 060)	2 775
TOR	(270)	1 420	1 150	(4 742)	2 910	(1 832)
UAG	18	0	18	(12 149)	8 810	(3 339)

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Ce qui suit est une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières négociables admises à la cote sur une Bourse officielle	115,82	118,77
Valeurs mobilières négociables négociées sur un autre marché réglementé	15,81	10,95
Autres valeurs mobilières négociables	0,25	0,21
Fonds d'investissement	0,27	0,01
Contrats de mise en pension	0,09	0,15
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,09)	0,24
Instruments financiers dérivés compensés	0,58	(0,04)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,02	0,27
Titres vendus à découvert	S/O	(0,01)
Contrats de prise en pension	(30,96)	(20,86)
Opérations de financement de vente et rachat dos-à-dos	(0,37)	(9,07)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Australie	1,83	1,68
Belgique	0,07	S/O
Canada	1,46	1,32
Îles Caïmans	1,58	0,93
Danemark	4,20	9,64
France	7,82	12,23
Allemagne	0,86	0,00
Guernesey, îles Anglo-Normandes	S/O	0,07
Irlande	8,54	3,63
Italie	7,79	10,58
Japon	4,27	4,17
Luxembourg	0,02	0,01
Multinational	S/O	0,01
Pays-Bas	0,71	0,33
Nouvelle-Zélande	1,63	1,24
Pérou	0,07	0,17
Slovénie	0,04	0,03
Espagne	1,71	2,04
Suède	1,15	0,94
Royaume-Uni	25,93	30,24
États-Unis	62,20	50,67
Fonds d'investissement	0,27	0,01
Contrats de mise en pension	0,09	0,15
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,09)	0,24
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	0,58	(0,04)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,46	0,20
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	S/O	0,00
Options plafonnées sur l'inflation	(0,02)	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,88)	(0,23)
Options sur titres	S/O	(0,01)
Swaps de défaillance de crédit sur indices de crédit — vente de protection	0,00	0,00
Contrats de change à terme	(0,96)	(0,49)
Contrats de change à terme couverts	1,42	0,80
Titres vendus à découvert	S/O	(0,01)
Autres actifs et passifs courants	(32,75)	(30,55)
Actifs nets	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES NÉGOCIABLES				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Altar Bidco, Inc.				
5,500 % - 7,993 % éch. 01/02/2029	$	2 126	$ 2 037	0,00
American Airlines, Inc.				
8,993 % éch. 20/04/2028		65 500	65 326	0,11
Aramark Services, Inc.				
6,134 % éch. 11/03/2025		3 646	3 634	0,01
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC				
5,853 % éch. 12/02/2027		9 968	9 852	0,02
6,103 % éch. 15/01/2025		21 326	21 290	0,04
6,603 % éch. 01/12/2027		10 562	10 558	0,02
Axalta Coating Systems Dutch Holding BV				
7,506 % éch. 20/12/2029		2 337	2 342	0,00
Caesars Resort Collection LLC				
7,134 % éch. 23/12/2024		138 129	137 996	0,24
7,884 % éch. 21/07/2025		10 492	10 479	0,02
Carnival Corp.				
5,648 % éch. 30/06/2025	€	61 547	63 316	0,11
7,384 % éch. 30/06/2025	$	129 444	124 474	0,21
7,634 % éch. 18/10/2028		52 409	49 212	0,08
Cengage Learning, Inc.				
7,814 % éch. 14/07/2026		35 040	31 596	0,05
Charter Communications Operating LLC				
6,140 % éch. 01/02/2027		37 147	36 330	0,06
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.				
7,915 % éch. 21/08/2026		1 627	1 486	0,00
Coherent Corp.				
7,134 % éch. 02/07/2029		12 534	12 434	0,02
CommScope, Inc.				
7,634 % éch. 06/04/2026		15 818	14 952	0,03
Delos Finance SARL				
6,480 % éch. 06/10/2023		8 226	8 225	0,01
Diamond Sports Group LLC				
12,317 % éch. 25/05/2026		4 030	3 829	0,01
DirecTV Financing LLC				
9,384 % éch. 02/08/2027		39 425	38 468	0,07
Emerald TopCo, Inc.				
7,884 % éch. 24/07/2026		3 586	3 295	0,01
Envision Healthcare Corp.				
TBD % éch. 29/04/2027 µ		8 862	8 673	0,01
12,119 % éch. 29/04/2027		48 738	47 703	0,08
15,744 % éch. 28/04/2028		122 658	100 375	0,17
GVC Holdings PLC				
4,398 % éch. 29/03/2024	€	5 200	5 506	0,01
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
6,173 % éch. 22/06/2026	$	64 007	63 883	0,11
iHeartCommunications, Inc.				
7,384 % éch. 01/05/2026		262 150	241 096	0,42
7,634 % éch. 01/05/2026		25 119	23 211	0,04
INEOS Finance PLC				
3,898 % éch. 01/04/2024	€	99 239	105 724	0,18
Instant Brands Holdings, Inc.				
9,735 % éch. 12/04/2028	$	256	173	0,00
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
7,445 % éch. 01/02/2029		88 028	85 167	0,15
IQVIA, Inc.				
4,202 % éch. 07/03/2024	€	5 000	5 342	0,01
Lealand Finance Co. BV				
7,384 % éch. 28/06/2024	$	2 771	1 801	0,00
Lealand Finance Co. BV (3,000 % en numéraire ou 5,384 % de rémunération en nature)				
8,384 % éch. 30/06/2025 (c)		6 522	3 501	0,01
Marriott Ownership Resorts, Inc.				
6,134 % éch. 29/08/2025		2 034	2 017	0,00
Petco Health & Wellness Co., Inc.				
7,976 % éch. 03/03/2028		9 424	9 162	0,02
PetSmart, Inc.				
8,130 % éch. 11/02/2028		33 028	32 419	0,06
Poseidon BidCo S.A.S				
5,250 % - 7,452 % éch. 14/07/2028	€	103 800	95 449	0,16
PUG LLC				
7,884 % éch. 12/02/2027	$	13 187	10 978	0,02
8,634 % éch. 12/02/2027		983	818	0,00
Redstone Holdco 2 LP				
9,108 % éch. 27/04/2028	$	7 228	$ 5 039	0,01
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				
8,165 % éch. 16/11/2025		5 539	5 235	0,01
Serta Simmons Bedding LLC				
7,743 % - 7,827 % éch. 08/11/2023		1 414	100	0,00
Sierra Hamilton LLC				
15,000 % éch. 12/09/2023		1	1	0,00
Sigma Bidco BV				
3,738 % éch. 02/07/2025	€	28 800	26 779	0,05
SkyMiles IP Ltd.				
7,993 % éch. 20/10/2027	$	61 145	62 441	0,11
Sotera Health Holdings LLC				
7,165 % éch. 11/12/2026		17 409	16 146	0,03
SS&C European Holdings SARL				
6,134 % éch. 16/04/2025		8 613	8 484	0,01
SS&C Technologies, Inc.				
6,134 % éch. 16/04/2025		16 146	15 903	0,03
Sunshine Luxembourg SARL				
8,480 % éch. 01/10/2026		30 544	29 326	0,05
Surgery Center Holdings, Inc.				
8,050 % éch. 31/08/2026		8 962	8 871	0,02
Syniverse Holdings, Inc.				
11,580 % éch. 13/05/2027		27 246	23 908	0,04
Team Health Holdings, Inc.				
7,134 % éch. 06/02/2024		16 403	14 106	0,02
TransDigm, Inc.				
6,980 % éch. 30/05/2025		32 203	31 914	0,05
6,980 % éch. 09/12/2025		65 537	64 865	0,11
7,830 % éch. 22/02/2027		36 942	36 862	0,06
U.S. Renal Care, Inc.				
9,438 % éch. 26/06/2026		23 133	13 056	0,02
9,938 % éch. 26/06/2026		6 558	3 701	0,01
Uber Technologies, Inc.				
8,235 % éch. 04/04/2025		38 837	38 858	0,07
8,235 % éch. 25/02/2027		23 768	23 755	0,04
United Airlines, Inc.				
8,108 % éch. 21/04/2028		38 669	38 290	0,07
Univision Communications, Inc.				
7,134 % éch. 15/03/2024		18 409	18 413	0,03
Veritas U.S., Inc.				
9,730 % éch. 01/09/2025		1 996	1 419	0,00
Westmoreland Coal Co. (15,000 % de rémunération en nature)				
15,000 % éch. 15/03/2029 (c)		4 799	3 731	0,01
Windstream Services LLC				
10,673 % éch. 21/09/2027		16 958	15 423	0,03
Wm Morrison Supermarkets PLC				
6,552 % éch. 04/11/2027	€	67 914	63 964	0,11
6,552 % éch. 31/07/2028		37 044	34 890	0,06
Zayo Group Holdings, Inc.				
7,384 % éch. 09/03/2027	$	27 783	22 630	0,04
			2 122 239	3,66
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				
ADLER Group S.A.				
2,250 % éch. 27/04/2027	€	1 100	416	0,00
2,750 % éch. 13/11/2026		200	86	0,00
12,500 % éch. 31/07/2025 (l)		944	1 001	0,00
AGFC Capital Trust				
5,829 % éch. 15/01/2067	$	23 000	12 899	0,02
Ally Financial, Inc.				
8,000 % éch. 01/11/2031		2 846	2 967	0,01
Ambac Assurance Corp.				
5,100 % (h)		0	0	0,00
American Assets Trust LP				
3,375 % éch. 01/02/2031		6 400	5 091	0,01
Armor Holdco, Inc.				
8,500 % éch. 15/11/2029		800	602	0,00
Army Hawaii Family Housing Trust Certificates				
4,718 % éch. 15/06/2050		103 200	69 788	0,12
Banque de développement asiatique				
4,700 % éch. 12/03/2024	MXN	99 000	$ 4 674	0,01
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % éch. 18/11/2027	$	183 112	146 630	0,25
3,950 % éch. 01/07/2024		6 940	6 648	0,01
5,250 % éch. 15/05/2024		11 906	11 675	0,02
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
1,875 % éch. 09/01/2026	€	21 500	19 737	0,03
2,625 % éch. 28/04/2025		5 400	5 230	0,01
3,625 % éch. 24/09/2024		4 800	4 875	0,01
5,375 % éch. 18/01/2028		5 000	4 314	0,01
8,000 % éch. 22/01/2030		26 444	24 764	0,04
8,500 % éch. 10/09/2030		2 800	2 636	0,00
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % éch. 17/09/2024	PEN	95 500	23 390	0,04
Banco Espirito Santo S.A.				
2,625 % éch. 08/05/2017 ^	€	16 200	2 507	0,00
4,750 % éch. 15/01/2018 ^		8 100	1 253	0,00
Bank of Ireland Group PLC				
7,500 % éch. 19/05/2025 (h)(j)		102 118	106 197	0,18
Bank of Nova Scotia				
4,900 % éch. 04/06/2025 (h)(j)	$	3 346	3 216	0,01
Barclays PLC				
4,972 % éch. 16/05/2029		79 515	74 819	0,13
5,875 % éch. 15/09/2024 (h)(j)	£	10 517	11 622	0,02
6,125 % éch. 15/12/2025 (h)(j)	$	16 588	15 157	0,03
6,375 % éch. 15/12/2025 (h)(j)	£	11 100	12 275	0,02
7,125 % éch. 15/06/2025 (h)(j)		70 960	80 909	0,14
7,250 % éch. 15/03/2023 (h)(j)		69 909	83 335	0,14
7,437 % éch. 02/11/2033	$	10 700	11 244	0,02
7,750 % éch. 15/09/2023 (h)(j)		85 688	83 871	0,15
8,000 % éch. 15/06/2024 (h)(j)		36 100	35 165	0,06
Bevco Lux SARL				
1,000 % éch. 16/01/2030	€	15 000	12 064	0,02
BGC Partners, Inc.				
3,750 % éch. 01/10/2024	$	9 586	9 176	0,02
BNP Paribas Issuance BV				
0,000 % éch. 12/04/2024		10	1 631 979	2,82
CIFI Holdings Group Co. Ltd.				
4,375 % éch. 12/04/2027 ^		2 000	531	0,00
4,450 % éch. 17/08/2026 ^		1 700	449	0,00
4,800 % éch. 17/05/2028 ^		700	190	0,00
5,250 % éch. 13/05/2026 ^		1 100	291	0,00
5,950 % éch. 20/10/2025 ^		1 300	344	0,00
6,000 % éch. 16/07/2025 ^		2 000	526	0,00
6,450 % éch. 07/11/2024 ^		3 300	883	0,00
Corestate Capital Holding S.A.				
3,500 % éch. 15/04/2023 ^	€	30 000	5 012	0,01
Country Garden Holdings Co. Ltd.				
2,700 % éch. 12/07/2026	$	8 400	4 809	0,01
3,125 % éch. 22/10/2025		13 400	8 222	0,01
3,875 % éch. 22/10/2030		6 400	3 401	0,01
4,800 % éch. 06/08/2030		1 000	534	0,00
5,125 % éch. 17/01/2025		1 600	1 084	0,00
5,400 % éch. 27/05/2025		1 600	1 067	0,00
5,625 % éch. 14/01/2030		700	374	0,00
6,150 % éch. 17/09/2025		1 000	657	0,00
6,500 % éch. 08/04/2024		500	379	0,00
8,000 % éch. 27/01/2024		2 800	2 170	0,00

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CPI Property Group S.A.				
2,750 % éch. 12/05/2026	€	2 600	$ 2 185	0,00
2,750 % éch. 22/01/2028	£	1 700	1 370	0,00
Crédit Agricole S.A.				
7,875 % éch. 23/01/2024 (h)(j)	$	850	845	0,00
Credit Suisse AG				
6,500 % éch. 08/08/2023 (j)		59 125	57 393	0,10
Credit Suisse Group AG				
2,875 % éch. 02/04/2032	€	1 500	1 162	0,00
3,091 % éch. 14/05/2032	$	57 350	39 740	0,07
3,800 % éch. 09/06/2023		1 100	1 071	0,00
3,869 % éch. 12/01/2029		5 750	4 617	0,01
4,194 % éch. 01/04/2031		7 450	5 798	0,01
5,250 % éch. 11/02/2027 (h)(j)		5 300	3 462	0,01
6,250 % éch. 18/12/2024 (h)(j)		1 650	1 301	0,00
6,373 % éch. 15/07/2026		32 250	30 307	0,05
6,375 % éch. 21/08/2026 (h)(j)		11 570	8 321	0,01
6,442 % éch. 11/08/2028		109 450	99 836	0,17
6,537 % éch. 12/08/2033		98 373	86 558	0,15
7,250 % éch. 12/09/2025 (h)(j)		11 500	8 269	0,01
7,375 % éch. 07/09/2033	£	24 000	26 360	0,05
7,500 % éch. 17/07/2023 (h)(j)	$	45 544	36 509	0,06
7,500 % éch. 11/12/2023 (h)(j)		63 308	55 458	0,10
7,750 % éch. 01/03/2029	€	52 400	55 719	0,10
9,016 % éch. 15/11/2033	$	38 550	39 577	0,07
Dalian Wanda Commercial Management Group Co. Ltd.				
4,890 % éch. 17/04/2023	CNY	10 000	1 416	0,00
Deutsche Bank AG				
1,375 % éch. 17/02/2032	€	39 900	31 083	0,05
1,750 % éch. 19/11/2030		5 000	4 203	0,01
3,035 % éch. 28/05/2032 (l)(m)	$	45 920	34 907	0,06
3,547 % éch. 18/09/2031		20 300	16 318	0,03
4,625 % éch. 30/10/2027 (h)(j)	€	44 400	36 137	0,06
Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust				
5,250 % éch. 30/05/2025	$	181	179	0,00
EPR Properties				
4,750 % éch. 15/12/2026		7 623	6 859	0,01
4,950 % éch. 15/04/2028		2 170	1 855	0,00
Erste Group Bank AG				
4,250 % éch. 15/10/2027 (h)(j)	€	29 000	24 616	0,04
6,500 % éch. 15/04/2024 (h)(j)		2 800	2 923	0,01
Essential Properties LP				
2,950 % éch. 15/07/2031	$	4 000	2 918	0,01
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
3,950 % éch. 03/03/2031	CAD	6 700	4 334	0,01
4,850 % éch. 17/04/2028	$	4 291	4 063	0,01
FCE Bank PLC				
1,615 % éch. 11/05/2023	€	1 000	1 058	0,00
First-Citizens Bank & Trust Co.				
2,969 % éch. 27/09/2025	$	3 600	3 406	0,01
Ford Motor Credit Co. LLC				
1,744 % éch. 19/07/2024	€	20 969	21 427	0,04
2,330 % éch. 25/11/2025		1 019	1 004	0,00
2,684 % éch. 01/12/2024		5 220	5 387	0,01
2,748 % éch. 14/06/2024	£	36 179	41 241	0,07
4,535 % éch. 06/03/2025		9 479	10 865	0,02
5,125 % éch. 16/06/2025	$	6 500	6 263	0,01
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC				
6,500 % éch. 01/10/2025		8 741	8 234	0,01
Gaci First Investment Co.				
5,250 % éch. 13/10/2032		38 200	39 341	0,07
5,375 % éch. 13/10/2122		17 900	16 816	0,03
Gateway Casinos & Entertainment Ltd.				
5,000 % éch. 12/03/2038	CAD	48 002	31 285	0,05
GLP Capital LP				
3,250 % éch. 15/01/2032	$	5 000	4 004	0,01
4,000 % éch. 15/01/2031		16 467	14 155	0,02
5,250 % éch. 01/06/2025		3 502	3 448	0,01
5,300 % éch. 15/01/2029		16 214	15 373	0,03
Goodman U.S. Finance Three LLC				
3,700 % éch. 15/03/2028	$	11 640	$ 10 524	0,02
HSBC Holdings PLC				
2,357 % éch. 18/08/2031		46 700	35 783	0,06
2,804 % éch. 24/05/2032		25 700	19 943	0,03
2,848 % éch. 04/06/2031		3 600	2 881	0,01
3,973 % éch. 22/05/2030		46 600	40 881	0,07
4,583 % éch. 19/06/2029		15 300	14 113	0,02
4,950 % éch. 31/03/2030		1 600	1 530	0,00
6,000 % éch. 29/09/2023 (h)(j)	€	27 330	28 881	0,05
Huarong Finance Co. Ltd.				
3,375 % éch. 24/02/2030	$	3 193	2 437	0,00
3,625 % éch. 30/09/2030		6 670	5 119	0,01
3,875 % éch. 13/11/2029		7 798	6 170	0,01
4,250 % éch. 07/11/2027		2 700	2 311	0,00
4,500 % éch. 29/05/2029		13 916	11 563	0,02
4,625 % éch. 03/06/2026		1 729	1 528	0,00
4,750 % éch. 27/04/2027		7 390	6 457	0,01
4,950 % éch. 07/11/2047		4 700	3 231	0,01
InCaps Funding Ltd.				
6,761 % éch. 01/06/2033		2 321	2 192	0,00
Société financière internationale				
8,000 % éch. 09/10/2023	IDR	129 400 000	8 458	0,01
Intesa Sanpaolo SpA				
7,750 % éch. 11/01/2027 (h)(j)	€	14 475	14 943	0,03
8,248 % éch. 21/11/2033	$	3 900	3 968	0,01
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.				
3,250 % éch. 12/11/2025	€	9 400	7 888	0,01
Lloyds Banking Group PLC				
4,947 % éch. 27/06/2025 (h)(j)		19 577	20 059	0,04
7,500 % éch. 27/06/2024 (h)(j)	$	23 668	22 993	0,04
7,500 % éch. 27/09/2025 (h)(j)		7 476	7 231	0,01
7,875 % éch. 27/06/2029 (h)(j)	£	53 072	61 153	0,11
Morgan Stanley				
0,000 % éch. 02/04/2032 (l)	$	68 500	39 123	0,07
MPT Operating Partnership LP				
0,993 % éch. 15/10/2026	€	5 900	4 822	0,01
2,500 % éch. 24/03/2026	£	6 800	6 516	0,01
3,375 % éch. 24/04/2030		9 600	7 571	0,01
3,500 % éch. 15/03/2031	$	18 400	12 651	0,02
3,692 % éch. 05/06/2028	£	1 472	1 300	0,00
National Health Investors, Inc.				
3,000 % éch. 01/02/2031	$	9 900	7 160	0,01
Nationwide Building Society				
3,960 % éch. 18/07/2030		163 883	142 222	0,25
4,302 % éch. 08/03/2029		34 100	30 825	0,05
NatWest Group PLC				
4,445 % éch. 08/05/2030	$	121 125	$ 109 927	0,19
4,600 % éch. 28/06/2031 (h)(j)		4 100	2 946	0,01
4,892 % éch. 18/05/2029		62 833	59 565	0,10
5,076 % éch. 27/01/2030		134 670	127 134	0,22
Navient Corp.				
5,500 % éch. 25/01/2023		26 350	26 348	0,05
5,625 % éch. 25/01/2025		3 549	3 207	0,01
New Metro Global Ltd.				
4,500 % éch. 02/05/2026		4 600	3 127	0,01
4,625 % éch. 15/10/2025		800	562	0,00
4,800 % éch. 15/12/2024		7 900	6 128	0,01
6,800 % éch. 05/08/2023		3 100	2 867	0,01
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
2,750 % éch. 09/03/2028		21 400	17 367	0,03
Nomura Holdings, Inc.				
2,172 % éch. 14/07/2028		14 968	12 385	0,02
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
2,000 % éch. 01/10/2047	DKK	0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
2,000 % éch. 01/07/2037		0	0	0,00
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
Omega Healthcare Investors, Inc.				
3,250 % éch. 15/04/2033	$	12 852	9 324	0,02
3,625 % éch. 01/10/2029		9 874	8 120	0,01
4,750 % éch. 15/01/2028		2 670	2 465	0,00
OneMain Finance Corp.				
5,625 % éch. 15/03/2023		111 724	111 488	0,19
6,125 % éch. 15/03/2024		14 595	14 150	0,02
Owl Rock Capital Corp.				
2,875 % éch. 11/06/2028		5 600	4 406	0,01
Park Aerospace Holdings Ltd.				
4,500 % éch. 15/03/2023		40 005	39 909	0,07
5,500 % éch. 15/02/2024		13 831	13 657	0,02
Preferred Term Securities Ltd.				
4,969 % éch. 22/12/2036		376	339	0,00
5,059 % éch. 22/06/2037		16 016	14 560	0,03
5,069 % éch. 22/03/2037		16 887	15 494	0,03
5,069 % éch. 22/09/2037		16 562	15 056	0,03
5,079 % éch. 22/12/2036		20 311	18 889	0,03
5,109 % éch. 22/09/2036		1 354	1 239	0,00
5,119 % éch. 22/12/2035		9 601	8 786	0,02
5,119 % éch. 22/03/2038		9 642	9 006	0,02
5,139 % éch. 22/09/2037		11 820	10 283	0,02
5,149 % éch. 23/09/2035		811	807	0,00
5,149 % éch. 22/03/2037		13 164	11 189	0,02
5,169 % éch. 22/03/2038		13 086	11 780	0,02
5,199 % éch. 22/12/2035		2 196	1 944	0,00
5,219 % éch. 22/03/2038		9 253	8 236	0,01
5,226 % éch. 26/09/2034		7 514	7 027	0,01
5,249 % éch. 23/09/2035		6 666	6 060	0,01
5,349 % éch. 23/03/2035		10 000	9 175	0,02
5,613 % éch. 03/07/2033		866	810	0,00
5,669 % éch. 22/03/2038		744	705	0,00
Realkredit Danmark A/S				
2,500 % éch. 01/04/2047	DKK	0	0	0,00
Santander UK Group Holdings PLC				
2,469 % éch. 11/01/2028	$	5 600	4 790	0,01
3,823 % éch. 03/11/2028		17 900	16 024	0,03
6,750 % éch. 24/06/2024 (h)(j)	£	65 803	76 271	0,13
SBA Tower Trust				
2,836 % éch. 15/01/2050	$	5 885	5 551	0,01
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
5,125 % éch. 29/10/2022 ^		6 100	713	0,00
Seazen Group Ltd.				
4,450 % éch. 13/07/2025		1 900	1 339	0,00
6,000 % éch. 12/08/2024		5 000	3 930	0,01
6,150 % éch. 15/04/2023		200	189	0,00
SLM Corp.				
4,200 % éch. 29/10/2025		2 686	2 462	0,00
SLM Student Loan Trust				
2,596 % éch. 15/12/2033	€	12 553	12 787	0,02
Société Générale S.A.				
2,889 % éch. 09/06/2032	$	14 300	11 034	0,02
7,375 % éch. 04/10/2023 (h)(j)		26 505	25 427	0,04

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Standard Chartered PLC				
2,678 % éch. 29/06/2032	$	3 500	$ 2 648	0,00
State Agency of Roads of Ukraine				
6,250 % éch. 24/06/2030 ^		200	36	0,00
Stichting AK Rabobank Certificaten				
6,500 % (h)	€	206 326	211 766	0,37
Sunac China Holdings Ltd.				
6,500 % éch. 10/01/2025 ^	$	1 700	373	0,00
6,500 % éch. 26/01/2026 ^		600	125	0,00
6,650 % éch. 03/08/2024 ^		700	152	0,00
7,500 % éch. 01/02/2024 ^		800	178	0,00
8,350 % éch. 19/04/2023 ^		5 300	1 169	0,00
Svenska Handelsbanken AB				
4,750 % éch. 01/03/2031 (h)(j)		9 600	7 884	0,01
TP ICAP Finance PLC				
5,250 % éch. 29/05/2026	£	29 239	32 561	0,06
U.S. Capital Funding Ltd.				
4,189 % éch. 10/07/2043	$	5 107	4 060	0,01
5,190 % éch. 01/08/2034		1 057	1 044	0,00
UBS AG				
5,125 % éch. 15/05/2024 (j)		62 545	61 866	0,11
UBS Group AG				
2,746 % éch. 11/02/2033		3 116	2 416	0,00
UniCredit SpA				
7,830 % éch. 04/12/2023		324 870	328 308	0,57
Unique Pub Finance Co. PLC				
7,395 % éch. 28/03/2024	£	3 357	4 035	0,01
Uniti Group LP				
4,750 % éch. 15/04/2028	$	11 366	9 109	0,02
7,875 % éch. 15/02/2025		143 356	139 073	0,24
VICI Properties LP				
3,500 % éch. 15/02/2025		42 516	40 155	0,07
3,750 % éch. 15/02/2027		39 100	35 557	0,06
3,875 % éch. 15/02/2029		13 080	11 483	0,02
4,125 % éch. 15/08/2030		10 116	8 870	0,02
4,250 % éch. 01/12/2026		31 400	29 363	0,05
4,500 % éch. 01/09/2026		11 028	10 393	0,02
4,500 % éch. 15/01/2028		900	831	0,00
4,625 % éch. 15/06/2025		5 648	5 422	0,01
4,625 % éch. 01/12/2029		32 600	29 721	0,05
5,625 % éch. 01/05/2024		9 505	9 430	0,02
5,750 % éch. 01/02/2027		25 355	24 748	0,04
Voyager Aviation Holdings LLC				
8,500 % éch. 09/05/2026		4 668	3 705	0,01
Yango Group Co. Ltd.				
6,900 % éch. 31/10/2022 ^	CNY	50 000	954	0,00
			6 012 957	10,37
INDUSTRIE				
AA Bond Co. Ltd.				
4,875 % éch. 31/07/2043	£	16 680	19 018	0,03
5,500 % éch. 31/07/2050		4 875	5 087	0,01
Air Canada Pass-Through Trust				
5,250 % éch. 01/10/2030	$	30 187	28 565	0,05
Alaska Airlines Pass-Through Trust				
4,800 % éch. 15/02/2029		16 758	15 980	0,03
Altice Financing S.A.				
4,250 % éch. 15/08/2029	€	9 490	8 220	0,01
5,750 % éch. 15/08/2029	$	71 503	56 376	0,10
Altice France S.A.				
8,125 % éch. 01/02/2027		24 392	22 268	0,04
Amdocs Ltd.				
2,538 % éch. 15/06/2030		4 600	3 734	0,01
American Airlines Pass-Through Trust				
2,875 % éch. 11/01/2036		21 819	17 623	0,03
3,000 % éch. 15/04/2030		1 754	1 524	0,00
3,150 % éch. 15/08/2033		1 037	861	0,00
3,350 % éch. 15/04/2031		10 598	9 174	0,02
3,375 % éch. 01/11/2028	$	25 001	$ 20 898	0,04
3,575 % éch. 15/07/2029		3 863	3 456	0,01
3,700 % éch. 01/04/2028		32 110	27 776	0,05
4,000 % éch. 15/08/2030		5 430	4 368	0,01
American Airlines, Inc.				
5,500 % éch. 20/04/2026		57 855	55 738	0,10
Atlantia SpA				
1,875 % éch. 12/02/2028	€	68 400	60 864	0,11
Baptist Healthcare System Obligated Group				
3,540 % éch. 15/08/2050	$	13 100	9 464	0,02
Boeing Co.				
3,600 % éch. 01/05/2034		4 300	3 451	0,01
5,705 % éch. 01/05/2040		48 775	46 719	0,08
5,805 % éch. 01/05/2050		218 729	203 915	0,35
5,930 % éch. 01/05/2060		142 982	131 018	0,23
6,125 % éch. 15/02/2033		14 822	15 112	0,03
Bombardier, Inc.				
7,500 % éch. 15/03/2025		9 032	8 963	0,02
British Airways Pass-Through Trust				
2,900 % éch. 15/09/2036		7 479	6 109	0,01
3,300 % éch. 15/06/2034		3 429	2 918	0,01
3,800 % éch. 20/03/2033		2 590	2 339	0,00
4,250 % éch. 15/05/2034		6 769	6 074	0,01
Broadcom, Inc.				
2,450 % éch. 15/02/2031		44 400	35 074	0,06
2,600 % éch. 15/02/2033		17 500	13 182	0,02
3,137 % éch. 15/11/2035		5 227	3 859	0,01
3,187 % éch. 15/11/2036		89 142	64 309	0,11
3,419 % éch. 15/04/2033		30 700	24 698	0,04
3,469 % éch. 15/04/2034		137 989	110 488	0,19
3,500 % éch. 15/02/2041		13 583	9 694	0,02
4,150 % éch. 15/11/2030		1 600	1 438	0,00
4,300 % éch. 15/11/2032		10 600	9 373	0,02
4,926 % éch. 15/05/2037		22 413	19 633	0,03
California Institute of Technology				
4,283 % éch. 01/09/2116		9 100	6 852	0,01
Cameron LNG LLC				
3,402 % éch. 15/01/2038		867	707	0,00
Carnival Corp.				
4,000 % éch. 01/08/2028		12 256	10 018	0,02
10,500 % éch. 01/02/2026		2 796	2 814	0,00
Carvana Co.				
5,500 % éch. 15/04/2027		39 694	15 776	0,03
10,250 % éch. 01/05/2030		204 910	96 667	0,17
CDW LLC				
2,670 % éch. 01/12/2026		7 600	6 762	0,01
3,569 % éch. 01/12/2031		26 300	21 721	0,04
Cellnex Finance Co. S.A.				
3,875 % éch. 07/07/2041		10 800	7 403	0,01
Champion Path Holdings Ltd.				
4,500 % éch. 27/01/2026		10 800	9 430	0,02
4,850 % éch. 27/01/2028		28 700	24 214	0,04
Charter Communications Operating LLC				
3,850 % éch. 01/04/2061		30 300	17 631	0,03
3,900 % éch. 01/06/2052		112 300	70 921	0,12
3,950 % éch. 30/06/2062		34 400	20 416	0,04
4,400 % éch. 01/12/2061		49 200	31 657	0,05
Community Health Systems, Inc.				
5,625 % éch. 15/03/2027		167 529	143 954	0,25
8,000 % éch. 15/03/2026		102 191	93 249	0,16
Constellation Oil Services Holding S.A.				
13,500 % éch. 30/06/2025		1 250	1 243	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature)				
3,000 % éch. 31/12/2026 (c)		2 913	1 724	0,00
CoStar Group, Inc.				
2,800 % éch. 15/07/2030		11 362	9 305	0,02
CVS Pass-Through Trust				
4,163 % éch. 11/08/2036		1 446	1 253	0,00
4,704 % éch. 10/01/2036		5 416	4 872	0,01
5,926 % éch. 10/01/2034		766	748	0,00
6,036 % éch. 10/12/2028		2 749	2 709	0,00
6,943 % éch. 10/01/2030		5 444	5 546	0,01
7,507 % éch. 10/01/2032		6 182	6 436	0,01
8,353 % éch. 10/07/2031		4 859	5 314	0,01
Directv Financing LLC				
5,875 % éch. 15/08/2027		13 920	12 480	0,02
DISH DBS Corp.				
5,250 % éch. 01/12/2026	$	72 570	$ 61 264	0,11
5,750 % éch. 01/12/2028		81 200	64 960	0,11
Dufry One BV				
3,625 % éch. 15/04/2026	CHF	2 687	2 557	0,00
Energy Transfer LP				
4,950 % éch. 15/05/2028	$	2 500	2 402	0,00
Exela Intermediate LLC				
11,500 % éch. 15/07/2026		5 923	1 037	0,00
Expedia Group, Inc.				
2,950 % éch. 15/03/2031		6 774	5 463	0,01
3,250 % éch. 15/02/2030		5 360	4 559	0,01
6,250 % éch. 01/05/2025		3 740	3 775	0,01
Ford Foundation				
2,815 % éch. 01/06/2070		7 900	4 646	0,01
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.				
2,250 % éch. 22/11/2024	€	500	350	0,00
2,949 % éch. 24/01/2024		56 890	45 840	0,08
4,250 % éch. 06/04/2024	£	500	421	0,00
4,950 % éch. 23/03/2027	$	20 300	14 216	0,02
4,950 % éch. 06/02/2028		24 600	18 888	0,03
5,150 % éch. 11/02/2026		32 700	25 342	0,04
7,288 % éch. 16/08/2037		18 510	15 745	0,03
8,625 % éch. 28/04/2034		38 699	22 675	0,04
Global Payments, Inc.				
5,400 % éch. 15/08/2032		600	573	0,00
goeasy Ltd.				
5,375 % éch. 01/12/2024		900	865	0,00
Greene King Finance PLC				
4,064 % éch. 15/03/2035	£	3 962	4 038	0,01
5,106 % éch. 15/03/2034		3 190	3 383	0,01
Hyatt Hotels Corp.				
4,850 % éch. 15/03/2026	$	3 300	3 247	0,01
IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % en numéraire ou 4,625 % en PIK)				
3,875 % éch. 15/05/2027 (c)	€	100	91	0,00
IHO Verwaltungs GmbH (6,000 % en numéraire ou 6,750 % en PIK)				
6,000 % éch. 15/05/2027 (c)	$	7 574	6 661	0,01
Imperial Brands Finance Netherlands BV				
1,750 % éch. 18/03/2033	€	5 290	3 991	0,01
Imperial Brands Finance PLC				
3,500 % éch. 26/07/2026	$	3 894	3 576	0,01
Integris Baptist Medical Center, Inc.				
3,875 % éch. 15/08/2050		10 500	7 635	0,01
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
6,500 % éch. 15/03/2030		337 627	302 679	0,52
JetBlue Pass-Through Trust				
4,000 % éch. 15/05/2034		40 723	36 316	0,06
Market Bidco Finco PLC				
4,750 % éch. 04/11/2027	€	103 700	89 300	0,15
Marriott International, Inc.				
2,850 % éch. 15/04/2031	$	7 200	5 848	0,01
4,625 % éch. 15/06/2030		2 396	2 241	0,00
Massachusetts Institute of Technology				
4,678 % éch. 01/07/2114		375	322	0,00
5,600 % éch. 01/07/2111		597	622	0,00
Melco Resorts Finance Ltd.				
4,875 % éch. 06/06/2025		200	184	0,00
5,375 % éch. 04/12/2029		50 780	40 832	0,07
5,625 % éch. 17/07/2027		1 650	1 418	0,00
5,750 % éch. 21/07/2028		900	754	0,00
MGM China Holdings Ltd.				
4,750 % éch. 01/02/2027		7 818	6 926	0,01
5,250 % éch. 18/06/2025		19 681	18 540	0,03
Mitchells & Butlers Finance PLC				
5,219 % éch. 15/12/2030		4 303	3 988	0,01
6,013 % éch. 15/12/2030	£	5 849	6 574	0,01
Netflix, Inc.				
3,625 % éch. 15/05/2027	€	27 624	28 435	0,05
3,625 % éch. 15/06/2030		21 466	21 133	0,04
3,875 % éch. 15/11/2029		74 280	74 307	0,13
4,625 % éch. 15/05/2029		72 140	75 835	0,13
6,375 % éch. 15/05/2029	$	8 300	8 557	0,01
Nissan Motor Co. Ltd.				
3,201 % éch. 17/09/2028	€	86 900	81 522	0,14
3,522 % éch. 17/09/2025	$	58 000	53 933	0,09
4,345 % éch. 17/09/2027		82 724	75 140	0,13
4,810 % éch. 17/09/2030		43 097	36 670	0,06

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
NMG Holding Co., Inc.			
7,125 % éch. 01/04/2026	$ 92 700	$ 87 053	0,15
Noble Finance Co. (11,000 % en numéraire ou 15,000 % de rémunération en nature)			
11,000 % éch. 15/02/2028 (c)	7 107	7 907	0,01
Norfolk Southern Corp.			
4,100 % éch. 15/05/2121	5 000	3 482	0,01
NPC Ukrenergo			
6,875 % éch. 09/11/2028 ^	1 000	178	0,00
Oracle Corp.			
3,850 % éch. 01/04/2060	28 599	19 128	0,03
3,950 % éch. 25/03/2051 (l)	18 539	13 289	0,02
4,100 % éch. 25/03/2061 (l)	26 800	18 726	0,03
PeaceHealth Obligated Group			
3,218 % éch. 15/11/2050	13 300	8 690	0,02
Petroleos de Venezuela S.A.			
5,375 % éch. 12/04/2027 ^	53 114	2 589	0,00
5,500 % éch. 12/04/2037 ^	50 574	2 467	0,00
6,000 % éch. 16/05/2024 ^	47 576	2 438	0,00
6,000 % éch. 15/11/2026 ^	63 177	3 080	0,01
9,750 % éch. 17/05/2035 ^	28 330	1 452	0,00
Petroleos Mexicanos			
2,750 % éch. 21/04/2027	€ 7 200	6 031	0,01
5,950 % éch. 28/01/2031	$ 112 761	85 601	0,15
6,700 % éch. 16/02/2032	383 028	301 520	0,52
6,750 % éch. 21/09/2047	2 466	1 579	0,00
6,950 % éch. 28/01/2060	60 850	38 603	0,07
7,690 % éch. 23/01/2050	9 240	6 414	0,01
Prime Healthcare Services, Inc.			
7,250 % éch. 01/11/2025	35 984	30 463	0,05
Prosus NV			
1,207 % éch. 19/01/2026	€ 7 100	6 844	0,01
1,985 % éch. 13/07/2033	10 500	7 610	0,01
2,085 % éch. 19/01/2030	3 900	3 252	0,01
2,778 % éch. 19/01/2034	8 700	6 708	0,01
3,061 % éch. 13/07/2031	$ 4 600	3 558	0,01
3,257 % éch. 19/01/2027	10 800	9 670	0,02
4,193 % éch. 19/01/2032	3 700	3 072	0,01
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.			
9,750 % éch. 01/12/2026	2 700	2 178	0,00
Roadster Finance DAC			
2,375 % éch. 08/12/2032	€ 7 000	5 607	0,01
Rolls-Royce PLC			
1,625 % éch. 09/05/2028	3 987	3 387	0,01
3,375 % éch. 18/06/2026	£ 24 703	25 705	0,04
3,625 % éch. 14/10/2025	$ 17 903	16 560	0,03
4,625 % éch. 16/02/2026	€ 72 915	75 678	0,13
5,750 % éch. 15/10/2027	£ 24 271	26 875	0,05
Royal Caribbean Cruises Ltd.			
11,500 % éch. 01/06/2025	$ 41 527	44 629	0,08
Russian Railways Via RZD Capital PLC			
7,487 % éch. 25/03/2031 ^	£ 13 950	9 067	0,02
Sands China Ltd.			
2,800 % éch. 08/03/2027	$ 15 600	13 381	0,02
3,350 % éch. 08/03/2029	11 200	9 165	0,02
3,750 % éch. 08/08/2031	9 900	7 804	0,01
4,300 % éch. 08/01/2026	15 937	14 728	0,03
4,875 % éch. 18/06/2030	11 980	10 544	0,02
5,625 % éch. 08/08/2025	46 640	44 653	0,08
5,900 % éch. 08/08/2028	47 410	44 455	0,08
Seagate HDD Cayman			
4,091 % éch. 01/06/2029	1 300	1 080	0,00
Spirit Airlines Pass-Through Trust			
4,100 % éch. 01/10/2029	612	546	0,00
Sprint Spectrum Co. LLC			
4,738 % éch. 20/09/2029	25 473	25 185	0,04
Studio City Finance Ltd.			
5,000 % éch. 15/01/2029	11 340	8 389	0,01
Surgery Center Holdings, Inc.			
10,000 % éch. 15/04/2027	960	978	0,00
Sutter Health			
3,161 % éch. 15/08/2040	2 900	2 178	0,00
3,361 % éch. 15/08/2050	19 400	13 234	0,02
Syngenta Finance NV			
4,441 % éch. 24/04/2023	1 900	1 892	0,00
4,892 % éch. 24/04/2025	4 948	4 797	0,01
Times Square Hotel Trust			
8,528 % éch. 01/08/2026	1 680	1 660	0,00
Topaz Solar Farms LLC			
4,875 % éch. 30/09/2039	$ 5 609	$ 4 992	0,01
5,750 % éch. 30/09/2039	47 582	45 228	0,08
U.S. Airways Pass-Through Trust			
3,950 % éch. 15/05/2027	3 067	2 790	0,00
U.S. Renal Care, Inc.			
10,625 % éch. 15/07/2027	7 490	1 648	0,00
Uber Technologies, Inc.			
7,500 % éch. 15/05/2025	22 817	22 834	0,04
8,000 % éch. 01/11/2026	1 180	1 186	0,00
United Airlines Pass-Through Trust			
2,700 % éch. 01/11/2033	19 734	15 977	0,03
3,500 % éch. 01/09/2031	809	701	0,00
3,750 % éch. 03/03/2028	8 389	7 733	0,01
4,000 % éch. 11/10/2027	530	493	0,00
4,150 % éch. 11/10/2025	349	338	0,00
4,150 % éch. 25/02/2033	773	686	0,00
5,875 % éch. 15/04/2029	95 833	94 619	0,16
United Group BV			
4,875 % éch. 01/07/2024	€ 6 077	6 060	0,01
Valaris Ltd. (8,250 % en numéraire ou 12,000 % de rémunération en nature)			
8,250 % éch. 30/04/2028 (c)	$ 1 983	1 997	0,00
Venture Global Calcasieu Pass LLC			
3,875 % éch. 15/08/2029	38 600	33 843	0,06
3,875 % éch. 01/11/2033	164 200	134 438	0,23
4,125 % éch. 15/08/2031	37 800	32 272	0,06
Veritas U.S., Inc.			
7,500 % éch. 01/09/2025	4 090	2 826	0,00
ViaSat, Inc.			
5,625 % éch. 15/09/2025	28 739	26 709	0,05
Viking Cruises Ltd.			
13,000 % éch. 15/05/2025	31 212	32 980	0,06
Viking Ocean Cruises Ship Ltd.			
5,625 % éch. 15/02/2029	4 400	3 548	0,01
VOC Escrow Ltd.			
5,000 % éch. 15/02/2028	10 500	9 048	0,02
Wabtec Transportation Netherlands BV			
1,250 % éch. 03/12/2027	€ 9 496	8 617	0,01
Weir Group PLC			
2,200 % éch. 13/05/2026	$ 20 600	18 293	0,03
Wesco Aircraft Holdings, Inc. (7,500 % en numéraire et 3,000 % de rémunération en nature)			
10,500 % éch. 15/11/2026 (c)	30 072	27 742	0,05
Wesleyan University			
4,781 % éch. 01/07/2116	2 100	1 647	0,00
Western Midstream Operating LP			
5,041 % éch. 13/01/2023	5 587	5 579	0,01
Windstream Escrow LLC			
7,750 % éch. 15/08/2028	36 560	29 876	0,05
Wynn Las Vegas LLC			
5,250 % éch. 15/05/2027	7 180	6 491	0,01
5,500 % éch. 01/03/2025	21 637	20 586	0,04
Wynn Macau Ltd.			
4,875 % éch. 01/10/2024	5 648	5 341	0,01
5,125 % éch. 15/12/2029	23 790	19 287	0,03
5,500 % éch. 15/01/2026	53 600	49 254	0,09
5,500 % éch. 01/10/2027	7 714	6 755	0,01
5,625 % éch. 26/08/2028	43 978	37 658	0,07
Wynn Resorts Finance LLC			
7,750 % éch. 15/04/2025	6 593	6 567	0,01
		4 843 856	8,35
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS			
Enel Finance America LLC			
7,100 % éch. 14/10/2027	18 600	19 265	0,03
Enel Finance International NV			
7,500 % éch. 14/10/2032	14 500	15 367	0,03
7,750 % éch. 14/10/2052	9 400	10 092	0,02
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC			
2,950 % éch. 27/01/2029	183 800	127 741	0,22
Pacific Gas & Electric Co.			
1,700 % éch. 15/11/2023	46 400	44 923	0,08
2,100 % éch. 01/08/2027	7 177	6 140	0,01
2,500 % éch. 01/02/2031	12 391	9 642	0,02
2,950 % éch. 01/03/2026 ^	100 075	91 832	0,16
3,000 % éch. 15/06/2028	31 800	27 552	0,05
3,150 % éch. 01/01/2026	$ 60 363	$ 56 155	0,10
3,250 % éch. 15/06/2023 ^	59 082	58 436	0,10
3,250 % éch. 16/02/2024	66 100	64 546	0,11
3,250 % éch. 01/06/2031	37 030	30 189	0,05
3,300 % éch. 15/03/2027 ^	19 465	17 343	0,03
3,300 % éch. 01/12/2027 ^	106 702	94 342	0,16
3,300 % éch. 01/08/2040	5 115	3 481	0,01
3,400 % éch. 15/08/2024 ^	52 193	50 116	0,09
3,450 % éch. 01/07/2025	103 044	97 642	0,17
3,500 % éch. 15/06/2025 ^	63 544	60 011	0,10
3,500 % éch. 01/08/2050	12 179	7 611	0,01
3,750 % éch. 15/02/2024 ^	29 892	29 287	0,05
3,750 % éch. 01/07/2028	113 694	101 049	0,17
3,750 % éch. 15/08/2042 ^	20 803	14 029	0,02
3,850 % éch. 15/11/2023 ^	17 368	17 126	0,03
3,950 % éch. 01/12/2047 ^	4 700	3 205	0,01
4,000 % éch. 01/12/2046 ^	16 783	11 298	0,02
4,200 % éch. 01/03/2029	32 300	28 907	0,05
4,200 % éch. 01/06/2041	4 900	3 646	0,01
4,250 % éch. 01/08/2023	30 771	30 620	0,05
4,250 % éch. 15/03/2046 ^	25 035	17 509	0,03
4,300 % éch. 15/03/2045 ^	66 234	47 205	0,08
4,400 % éch. 01/03/2032	33 000	28 891	0,05
4,450 % éch. 15/04/2042 ^	33 949	25 391	0,04
4,500 % éch. 01/07/2040	87 391	68 621	0,12
4,500 % éch. 15/12/2041 ^	4 657	3 304	0,01
4,550 % éch. 01/07/2030	210 515	191 303	0,33
4,600 % éch. 15/06/2043 ^	41 543	31 538	0,05
4,650 % éch. 01/08/2028	4 100	3 777	0,01
4,750 % éch. 15/02/2044 ^	31 088	23 904	0,04
4,950 % éch. 08/06/2025	15 300	15 078	0,03
4,950 % éch. 01/07/2050	160 171	124 793	0,21
5,250 % éch. 01/03/2052	33 000	27 091	0,05
5,450 % éch. 15/06/2027	12 900	12 742	0,02
5,900 % éch. 15/06/2032	10 000	9 787	0,02
Peru LNG SRL			
5,375 % éch. 22/03/2030	600	502	0,00
Petrobras Global Finance BV			
6,250 % éch. 14/12/2026	£ 37 833	44 203	0,08
6,625 % éch. 16/01/2034	6 800	7 113	0,01
PG&E Wildfire Recovery Funding LLC			
4,263 % éch. 01/06/2038	$ 20 100	18 689	0,03
4,377 % éch. 03/06/2041	22 200	19 865	0,03
4,451 % éch. 01/12/2049	22 830	19 900	0,03
Rio Oil Finance Trust			
8,200 % éch. 06/04/2028	16 939	17 189	0,03
9,250 % éch. 06/07/2024	10 994	11 160	0,02
9,750 % éch. 06/01/2027	7 687	7 997	0,01
Sprint Capital Corp.			
8,750 % éch. 15/03/2032	12 200	14 547	0,02
Sprint LLC			
7,125 % éch. 15/06/2024	94 180	96 227	0,17
7,625 % éch. 01/03/2026	20 490	21 607	0,04
7,875 % éch. 15/09/2023	220 500	224 069	0,39
		2 265 595	3,91
Total obligations et billets privés		13 122 408	22,63
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES			
Multiplan Corp. (6,000 % en numéraire ou 7,000 % de rémunération en nature)			
6,000 % éch. 15/10/2027 (c)	30 000	19 275	0,03
OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX			
Obligations Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2015			
7,750 % éch. 01/01/2042	952	968	0,00
Obligations Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2017			
7,045 % éch. 01/01/2029	2 205	2 236	0,00
Obligations Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2022			
0,000 % éch. 01/11/2043	56 528	24 802	0,04
Obligations Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021			
3,850 % éch. 01/06/2050	2 500	2 215	0,00
4,214 % éch. 01/06/2050	13 300	10 414	0,02
Billets Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, (ST APPROP Insured), Series 2021			
3,000 % éch. 01/06/2046	3 360	3 113	0,01

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Billets Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021			
1,850 % éch. 01/06/2031	$ 190	$ 187	0,00
Obligations Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010			
6,630 % éch. 01/02/2035	7 945	8 062	0,02
6,725 % éch. 01/04/2035	2 695	2 748	0,01
7,350 % éch. 01/07/2035	7 447	7 843	0,01
Obligations Pennsylvania Higher Education Assistance Agency Revenue Bonds, (GTD STD LNS Insured), Series 2006			
4,488 % éch. 25/10/2036	6 941	6 839	0,01
Obligations Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010			
6,050 % éch. 01/07/2032 ^	6 790	4 957	0,01
6,125 % éch. 01/07/2040 ^	435	317	0,00
Obligations Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, Series 2008			
5,375 % éch. 01/07/2022 ^	2 355	1 710	0,00
Obligations University of California Revenue Bonds, Series 2012			
4,858 % éch. 15/05/2112	12 280	10 388	0,02
		86 799	0,15
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Fannie Mae			
0,261 % éch. 25/03/2035 (a)	134	4	0,00
0,334 % éch. 25/05/2041	36	25	0,00
1,611 % éch. 25/10/2049 - 25/11/2049 (a)	41 723	5 428	0,01
1,661 % éch. 25/04/2044 - 25/02/2049 (a)	7 274	735	0,00
1,811 % éch. 25/05/2048 (a)	15 858	2 127	0,00
1,973 % éch. 25/08/2033	197	172	0,00
2,500 % éch. 25/12/2027 - 25/02/2028 (a)	5 032	215	0,00
3,000 % éch. 25/06/2042 - 25/02/2046 (a)	540	75	0,00
3,000 % éch. 01/09/2057	18 527	16 334	0,03
3,500 % éch. 25/12/2049 (a)	6 358	1 497	0,00
4,000 % éch. 01/01/2059	9 909	9 479	0,02
4,500 % éch. 25/09/2040	2 494	2 430	0,00
4,500 % éch. 25/12/2042 (a)	149	27	0,00
5,000 % éch. 01/05/2034 - 25/08/2037	7	7	0,00
5,500 % éch. 01/05/2033 - 25/05/2038	118	121	0,00
6,000 % éch. 01/12/2023 - 01/05/2038	0	0	0,00
6,500 % éch. 01/03/2029	0	0	0,00
7,000 % éch. 01/04/2029	0	0	0,00
13,268 % éch. 25/07/2037	6	7	0,00
Freddie Mac			
0,746 % éch. 25/01/2023 (a)	2 000	0	0,00
0,969 % éch. 25/04/2029 (a)	42 862	1 673	0,00
1,264 % éch. 15/01/2041	497	428	0,00
1,611 % éch. 25/12/2049 (a)	24 053	1 635	0,00
1,832 % éch. 15/11/2042 (a)	3 685	367	0,00
1,882 % éch. 15/01/2042 (a)	224	17	0,00
2,432 % éch. 15/03/2037 (a)	80	7	0,00
2,500 % éch. 15/09/2027 - 15/12/2027 (a)	5 406	235	0,00
2,972 % éch. 25/10/2046	5 276	5 056	0,01
3,000 % éch. 15/12/2032 - 15/04/2049 (a)	4 054	933	0,00
3,000 % éch. 01/11/2046 - 01/05/2049	2 216	1 986	0,00
3,500 % éch. 15/12/2032 - 15/06/2049 (a)	8 184	1 272	0,00
3,500 % éch. 01/07/2046 - 01/05/2049	8 937	8 306	0,02
3,771 % éch. 25/12/2047	4 712	4 671	0,01
4,000 % éch. 01/04/2025 - 01/11/2047	60	59	0,00
4,000 % éch. 15/06/2049 (a)	4 763	945	0,00
4,124 % éch. 15/10/2033	426	400	0,00
4,317 % éch. 25/10/2052	122 452	115 685	0,20
4,441 % éch. 25/11/2052	143 167	141 298	0,24
4,500 % éch. 01/08/2048	8 701	8 529	0,02
4,500 % éch. 15/05/2049 (a)	3 805	716	0,00
5,000 % éch. 15/02/2049 (a)	755	148	0,00
5,500 % éch. 01/08/2033 - 01/04/2036	0	0	0,00
6,000 % éch. 01/01/2033	$ 0	$ 0	0,00
6,500 % éch. 01/02/2032 - 25/11/2049	3 082	3 295	0,01
7,000 % éch. 01/12/2025 - 01/06/2037	7	2	0,00
8,000 % éch. 01/07/2030	0	0	0,00
Ginnie Mae			
0,000 % éch. 20/01/2049 - 20/05/2049 (a)	50 141	1 053	0,00
0,152 % éch. 16/05/2050 (a)	802	2	0,00
0,794 % éch. 20/12/2040	1 737	1 436	0,00
1,625 % éch. 20/12/2045	3 161	3 066	0,01
1,760 % éch. 20/12/2040	180	131	0,00
1,824 % éch. 16/01/2043 (a)	708	48	0,00
2,500 % éch. 20/04/2052	63 448	55 036	0,10
2,625 % éch. 20/07/2045	6 881	6 720	0,01
3,379 % éch. 20/06/2067	24 628	24 519	0,04
3,500 % éch. 20/03/2043 (a)	723	128	0,00
3,575 % éch. 20/07/2067	14 484	14 413	0,03
4,106 % éch. 20/09/2066	8 892	9 032	0,02
4,292 % éch. 20/08/2066	19	19	0,00
4,398 % éch. 20/09/2066	19 021	19 417	0,03
4,412 % éch. 20/04/2062	470	467	0,00
4,417 % éch. 20/07/2065	14 208	14 082	0,03
4,442 % éch. 20/01/2062	19	19	0,00
4,508 % éch. 20/09/2067	12 530	12 474	0,02
4,542 % éch. 20/08/2066	3 670	3 655	0,01
4,585 % éch. 20/06/2066	8 535	8 454	0,02
4,640 % éch. 20/07/2066	2 426	2 403	0,00
6,000 % éch. 15/04/2037 - 20/11/2038	0	0	0,00
6,500 % éch. 15/06/2023 - 15/09/2037	5	4	0,00
7,000 % éch. 20/08/2023 - 15/05/2038	3	1	0,00
7,500 % éch. 15/09/2023 - 20/01/2030	0	0	0,00
8,000 % éch. 15/07/2024 - 15/05/2032	1	0	0,00
8,040 % éch. 20/04/2037	8	8	0,00
8,500 % éch. 15/01/2031	0	0	0,00
Ginnie Mae, TBA			
3,500 % éch. 01/01/2053	609 700	560 616	0,97
4,000 % éch. 01/01/2053	137 100	129 753	0,22
4,500 % éch. 01/01/2053	161 700	156 885	0,27
Uniform Mortgage-Backed Security			
2,500 % éch. 01/06/2031 - 01/03/2032	347	324	0,00
3,000 % éch. 01/02/2025 - 01/12/2052	2 577 026	2 275 778	3,93
3,500 % éch. 01/11/2025 - 01/01/2053	908 573	830 211	1,43
4,000 % éch. 01/08/2030 - 01/07/2051	190 067	181 483	0,31
4,500 % éch. 01/11/2023 - 01/08/2048	13 113	12 916	0,02
5,000 % éch. 01/05/2026 - 01/04/2049	1 885	1 881	0,00
5,500 % éch. 01/12/2034	0	0	0,00
6,000 % éch. 01/08/2031 - 01/10/2038	1	0	0,00
6,500 % éch. 01/07/2031 - 01/10/2039	1	0	0,00
7,500 % éch. 01/04/2029 - 01/10/2030	1	1	0,00
8,000 % éch. 01/03/2030	1	1	0,00
8,500 % éch. 01/04/2025	0	0	0,00
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA			
2,000 % éch. 01/01/2038	200	178	0,00
2,500 % éch. 01/01/2038 - 01/02/2053	292 750	248 305	0,43
3,000 % éch. 01/02/2053	1 711 439	1 503 703	2,59
3,500 % éch. 01/01/2053	5 120 045	4 654 526	8,04
4,000 % éch. 01/01/2053	3 619 434	3 396 548	5,86
4,500 % éch. 01/02/2053	1 519 400	1 462 705	2,52
5,000 % éch. 01/01/2053	907 100	893 842	1,54
5,500 % éch. 01/01/2053	694 700	696 299	1,20
6,000 % éch. 01/01/2053	2 866 000	2 909 862	5,02
6,500 % éch. 01/01/2053	11 500	11 779	0,02
		20 440 529	35,26
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Obligations du Trésor américain			
2,500 % éch. 15/02/2045	$ 59 000	$ 44 475	0,08
2,875 % éch. 15/05/2043	69 079	56 448	0,10
2,875 % éch. 15/08/2045	510 010	411 116	0,71
3,000 % éch. 15/11/2044	371 252	306 747	0,53
3,000 % éch. 15/08/2048	81 815	67 229	0,12
3,000 % éch. 15/02/2049 (m)	10 169	8 380	0,02
3,125 % éch. 15/02/2043	178 076	152 088	0,26
3,125 % éch. 15/08/2044	283 117	239 499	0,41
3,125 % éch. 15/05/2048	55 840	46 958	0,08
3,375 % éch. 15/05/2044	416 095	367 301	0,63
3,625 % éch. 15/02/2044	145 436	133 534	0,23
3,750 % éch. 15/11/2043	80 988	75 983	0,13
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (g)			
0,125 % éch. 15/07/2024	563 467	545 369	0,94
0,125 % éch. 15/10/2024	378 183	364 254	0,63
0,125 % éch. 15/07/2030	299 343	268 212	0,46
0,125 % éch. 15/01/2031	10 989	9 766	0,02
0,125 % éch. 15/07/2031	44 503	39 355	0,07
0,250 % éch. 15/07/2029	856 559	784 640	1,35
0,250 % éch. 15/02/2050	112 539	75 999	0,13
0,375 % éch. 15/07/2023	536 372	530 031	0,91
0,375 % éch. 15/01/2027	18 776	17 712	0,03
0,375 % éch. 15/07/2027	5 067	4 778	0,01
0,500 % éch. 15/04/2024	515 258	501 118	0,86
0,625 % éch. 15/01/2024	701 417	686 585	1,18
0,625 % éch. 15/07/2032	498 828	457 304	0,79
0,625 % éch. 15/02/2043	15 682	12 666	0,02
0,750 % éch. 15/07/2028	167 186	159 337	0,28
0,750 % éch. 15/02/2042	44 440	37 235	0,06
0,750 % éch. 15/02/2045	147 632	119 530	0,21
0,875 % éch. 15/01/2029	200 955	191 552	0,33
0,875 % éch. 15/02/2047	114 181	93 717	0,16
1,000 % éch. 15/02/2046	61 244	52 073	0,09
1,000 % éch. 15/02/2048	135 697	114 349	0,20
1,000 % éch. 15/02/2049	356 926	298 703	0,52
1,375 % éch. 15/02/2044	17 132	15 927	0,03
2,125 % éch. 15/02/2040	22 609	23 952	0,04
2,125 % éch. 15/02/2041	10 205	10 820	0,02
Billets du Trésor américain			
1,500 % éch. 15/08/2026	56 200	51 239	0,09
2,000 % éch. 15/02/2025	15 000	14 276	0,03
2,000 % éch. 15/08/2025	110 000	103 894	0,18
2,000 % éch. 15/11/2026	9 100	8 416	0,01
2,125 % éch. 15/05/2025	132 200	125 668	0,22
2,250 % éch. 15/11/2025	57 430	54 370	0,09
2,250 % éch. 15/02/2027	262 600	244 433	0,42
2,375 % éch. 31/03/2029	139 700	127 048	0,22
2,375 % éch. 15/05/2029	255 400	232 234	0,40
2,625 % éch. 31/01/2026	631 400	603 443	1,04
2,750 % éch. 15/08/2032	832 400	758 134	1,31
2,875 % éch. 15/08/2028	500	471	0,00
2,875 % éch. 15/05/2032	171 690	158 277	0,27
4,000 % éch. 31/10/2029	592 900	593 224	1,02
		10 399 869	17,94
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES			
1211 Avenue of the Americas Trust			
4,092 % éch. 10/08/2035	9 600	8 666	0,02
4,142 % éch. 10/08/2035	7 400	6 244	0,01
20 Times Square Trust			
3,100 % éch. 15/05/2035	54 000	49 871	0,09
280 Park Avenue Mortgage Trust			
5,117 % éch. 15/09/2034	700	683	0,00
Adjustable Rate Mortgage Trust			
2,758 % éch. 25/08/2035	316	234	0,00
3,129 % éch. 25/09/2035	3 339	2 654	0,01
3,228 % éch. 25/05/2036 ^	123	107	0,00
3,623 % éch. 25/04/2035	6	5	0,00
3,845 % éch. 25/01/2036	549	431	0,00
4,123 % éch. 25/03/2037	843	701	0,00
4,536 % éch. 25/01/2036	279	246	0,00
4,629 % éch. 25/08/2036	12 222	4 609	0,01
4,729 % éch. 25/05/2036	5 726	2 197	0,00
4,809 % éch. 25/06/2037	2 802	3 311	0,01
4,929 % éch. 25/02/2036	182	108	0,00
5,539 % éch. 25/01/2035 ^	1 564	1 258	0,00
5,539 % éch. 25/03/2035	2 146	1 778	0,00
5,771 % éch. 25/11/2037 ^	794	565	0,00

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Alba PLC				
3,714 % éch. 17/03/2039	£	6 767	$ 7 675	0,01
3,767 % éch. 25/11/2042		1 913	2 138	0,00
3,834 % éch. 17/03/2039		7 502	8 072	0,01
Alliance Bancorp Trust				
4,869 % éch. 25/07/2037	$	1 015	835	0,00
American Home Mortgage Assets Trust				
2,748 % éch. 25/02/2047		24 939	10 321	0,02
2,968 % éch. 25/11/2046		30 906	9 840	0,02
2,988 % éch. 25/10/2046		4 288	2 989	0,01
3,332 % éch. 25/11/2035 ^		1 574	1 219	0,00
4,509 % éch. 25/10/2046		4 282	3 626	0,01
4,514 % éch. 25/03/2047		1 349	1 177	0,00
4,579 % éch. 25/10/2046		10 592	6 470	0,01
4,596 % éch. 25/08/2037 ^		1 962	1 728	0,00
4,769 % éch. 25/09/2046 ^		2 490	2 112	0,00
6,750 % éch. 25/11/2046		5 996	5 110	0,01
American Home Mortgage Investment Trust				
4,579 % éch. 25/05/2047		2 228	1 206	0,00
4,669 % éch. 25/03/2046		8 020	6 777	0,01
4,749 % éch. 25/12/2046		7 498	6 123	0,01
4,789 % éch. 25/03/2046		3 100	2 586	0,01
4,989 % éch. 25/09/2045		7 768	6 755	0,01
4,989 % éch. 25/11/2045		5 602	3 970	0,01
5,214 % éch. 25/02/2045		7 900	7 166	0,01
5,883 % éch. 25/09/2035		12 762	7 057	0,01
6,500 % éch. 25/03/2047		779	580	0,00
6,787 % éch. 25/09/2035		3 447	1 539	0,00
6,950 % éch. 25/06/2036		7 599	1 309	0,00
6,959 % éch. 25/12/2036		4 418	3 650	0,01
Angel Oak Mortgage Trust				
1,469 % éch. 25/06/2065		1 996	1 791	0,00
APS Resecuritization Trust				
2,558 % éch. 27/06/2049		2 326	2 098	0,00
Ashford Hospitality Trust				
5,568 % éch. 15/04/2035		3 000	2 832	0,01
5,718 % éch. 15/04/2035		2 500	2 321	0,01
Atlas Funding PLC				
3,894 % éch. 25/07/2058	£	22 063	26 337	0,05
Atrium Hotel Portfolio Trust				
5,498 % éch. 15/12/2036	$	3 300	3 215	0,01
6,068 % éch. 15/12/2036		4 000	3 838	0,01
6,618 % éch. 15/06/2035		47 513	44 419	0,08
Avon Finance PLC				
4,331 % éch. 20/09/2048	£	57 068	67 349	0,12
Banc of America Alternative Loan Trust				
4,789 % éch. 25/01/2037 ^	$	1 927	1 487	0,00
5,500 % éch. 25/12/2035 ^		162	143	0,00
5,913 % éch. 25/10/2036		10 135	2 980	0,01
6,000 % éch. 25/11/2035 ^		219	187	0,00
6,000 % éch. 25/04/2037 ^		376	296	0,00
6,000 % éch. 25/06/2046 ^		684	595	0,00
6,000 % éch. 25/06/2046		1 545	1 107	0,00
6,000 % éch. 25/07/2046 ^		1 494	1 248	0,00
6,500 % éch. 25/03/2036 ^		2 072	1 804	0,00
Banc of America Funding Corp.				
4,092 % éch. 25/09/2048		1 714	1 572	0,00
Banc of America Funding Trust				
2,943 % éch. 27/08/2036		17 676	16 610	0,03
3,006 % éch. 20/06/2032		3	3	0,00
3,155 % éch. 29/04/2037		7 145	6 193	0,01
3,242 % éch. 20/05/2035 ^		798	694	0,00
3,309 % éch. 20/07/2036		132	121	0,00
3,457 % éch. 20/05/2036 ^		223	197	0,00
3,635 % éch. 20/09/2035 ^		754	600	0,00
3,730 % éch. 20/05/2036 ^		267	244	0,00
3,745 % éch. 20/07/2047 ^		920	863	0,00
3,754 % éch. 20/05/2036		1 234	1 145	0,00
3,775 % éch. 20/01/2047 ^		164	139	0,00
3,782 % éch. 20/02/2036 ^		48	39	0,00
3,842 % éch. 20/06/2047		4 854	4 121	0,01
3,851 % éch. 20/11/2035		3 160	2 630	0,01
3,880 % éch. 20/09/2046 ^		89	73	0,00
4,081 % éch. 20/11/2034		39	37	0,00
4,120 % éch. 20/11/2035 ^		238	222	0,00
4,273 % éch. 20/01/2047 ^		1 718	1 571	0,00
4,276 % éch. 26/07/2036		5 061	3 789	0,01
4,449 % éch. 25/01/2037 ^		2 352	2 005	0,00
4,489 % éch. 25/04/2037 ^		3 365	2 914	0,01
4,599 % éch. 26/05/2037		7 073	6 062	0,01
4,669 % éch. 25/07/2037	$	205	$ 189	0,00
4,673 % éch. 20/02/2047		3 405	3 034	0,01
4,679 % éch. 25/07/2037		2 016	1 856	0,00
4,733 % éch. 20/10/2036		8 289	6 171	0,01
4,733 % éch. 20/12/2046 ^		1 057	865	0,00
4,773 % éch. 20/04/2047 ^		709	556	0,00
4,773 % éch. 20/06/2047		579	472	0,00
4,913 % éch. 20/06/2047		2 381	1 957	0,00
4,953 % éch. 20/05/2047		1 528	1 347	0,00
4,969 % éch. 25/05/2037		4 779	4 118	0,01
4,989 % éch. 25/08/2036 ^		199	180	0,00
5,468 % éch. 26/10/2036		9 922	9 122	0,02
5,500 % éch. 25/01/2036		36	36	0,00
5,500 % éch. 25/03/2036 ^		53	45	0,00
5,750 % éch. 25/11/2035		0	0	0,00
5,750 % éch. 25/03/2036		120	99	0,00
5,763 % éch. 25/10/2036		198	174	0,00
5,773 % éch. 25/05/2037		90	79	0,00
5,846 % éch. 25/01/2037 ^		197	171	0,00
6,000 % éch. 25/07/2036 ^		576	456	0,00
6,000 % éch. 25/08/2036		224	194	0,00
6,000 % éch. 25/09/2036 ^		737	614	0,00
6,000 % éch. 25/08/2037 ^		1 435	1 112	0,00
6,000 % éch. 26/10/2037		1 352	1 178	0,00
6,347 % éch. 25/01/2037		615	534	0,00
6,479 % éch. 25/10/2036		515	458	0,00
7,303 % éch. 20/07/2036		1 646	1 601	0,00
7,372 % éch. 26/07/2035		126	110	0,00
Banc of America Merrill Linch Trust				
5,882 % éch. 17/06/2050		200	66	0,00
Banc of America Mortgage Trust				
3,348 % éch. 25/01/2035		761	720	0,00
3,374 % éch. 25/02/2036		318	264	0,00
3,537 % éch. 20/10/2046 ^		245	222	0,00
3,696 % éch. 25/01/2036 ^		76	64	0,00
3,873 % éch. 20/11/2046 ^		154	136	0,00
3,942 % éch. 25/07/2035		1 089	985	0,00
3,947 % éch. 25/09/2035 ^		658	509	0,00
4,045 % éch. 25/08/2035 ^		1 397	1 320	0,00
6,000 % éch. 25/03/2037 ^		604	485	0,00
6,000 % éch. 25/05/2037		214	164	0,00
6,000 % éch. 25/07/2046 ^		18	16	0,00
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust				
6,209 % éch. 15/07/2037		10 000	9 536	0,02
6,709 % éch. 15/07/2037		28 583	26 998	0,05
BCAP LLC Trust				
0,000 % éch. 26/08/2036		1 238	494	0,00
3,074 % éch. 26/01/2037		4 386	3 694	0,01
3,150 % éch. 26/02/2036		1 070	1 058	0,00
3,341 % éch. 26/04/2047		2 963	2 641	0,01
3,364 % éch. 26/07/2037		3 678	3 209	0,01
3,423 % éch. 26/03/2037		0	0	0,00
3,863 % éch. 26/07/2037		589	518	0,00
4,611 % éch. 26/03/2037		217	211	0,00
4,669 % éch. 25/04/2037		1 639	1 472	0,00
4,749 % éch. 25/03/2037		6 319	5 499	0,01
4,769 % éch. 25/10/2036		58	55	0,00
4,809 % éch. 25/04/2037		65	59	0,00
4,809 % éch. 25/05/2047		237	214	0,00
4,889 % éch. 25/02/2047		1 112	949	0,00
5,250 % éch. 26/05/2037		2 818	1 475	0,00
5,500 % éch. 26/02/2036		932	671	0,00
5,689 % éch. 25/09/2047		1 099	954	0,00
6,250 % éch. 26/08/2036		3 207	1 587	0,00
6,789 % éch. 25/10/2047		2 558	2 100	0,00
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
2,839 % éch. 25/06/2035 ^		257	253	0,00
3,152 % éch. 25/02/2047		2 502	2 175	0,00
3,255 % éch. 25/05/2047 ^		3 276	2 906	0,01
3,290 % éch. 25/05/2047 ^		126	95	0,00
3,310 % éch. 25/07/2036 ^		214	183	0,00
3,354 % éch. 25/08/2047 ^		1 696	1 395	0,00
3,558 % éch. 25/03/2035		10	10	0,00
3,725 % éch. 25/10/2046		1 613	1 326	0,00
3,789 % éch. 25/10/2033		1	1	0,00
3,857 % éch. 25/10/2035		472	447	0,00
3,883 % éch. 25/07/2034		1	1	0,00
3,939 % éch. 25/06/2035 ^		21	20	0,00
3,981 % éch. 25/08/2035 ^		732	597	0,00
4,217 % éch. 25/02/2036 ^		2 448	2 126	0,00
6,662 % éch. 25/12/2046 ^		4 857	3 918	0,01
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,044 % éch. 25/10/2033	$	3	$ 2	0,00
3,115 % éch. 25/05/2035		372	346	0,00
3,234 % éch. 25/01/2047		563	267	0,00
3,354 % éch. 25/10/2035 ^		821	694	0,00
3,445 % éch. 25/09/2034		252	223	0,00
3,554 % éch. 25/05/2036 ^		1 393	1 006	0,00
3,586 % éch. 25/11/2036 ^		5 284	2 830	0,01
3,587 % éch. 25/09/2035 ^		1 721	721	0,00
3,605 % éch. 25/01/2036 ^		837	774	0,00
3,642 % éch. 25/08/2046 ^		4 550	3 232	0,01
3,679 % éch. 25/07/2035		733	627	0,00
3,697 % éch. 25/08/2036 ^		1 945	1 035	0,00
3,729 % éch. 25/09/2035 ^		1 594	991	0,00
3,734 % éch. 25/09/2035 ^		3 703	1 627	0,00
3,881 % éch. 25/12/2046 ^		260	188	0,00
3,899 % éch. 25/09/2035		1 549	1 261	0,00
3,929 % éch. 25/09/2047		20 019	12 046	0,02
4,198 % éch. 25/07/2035 ^		330	238	0,00
4,709 % éch. 25/08/2036		6 307	5 329	0,01
4,709 % éch. 25/06/2046 ^		3 240	2 699	0,01
4,709 % éch. 25/01/2047 ^		1 839	1 453	0,00
4,729 % éch. 25/08/2036 ^		17 355	14 966	0,03
4,729 % éch. 25/12/2046 ^		5 901	5 113	0,01
4,829 % éch. 25/04/2036 ^		3 003	4 153	0,01
4,869 % éch. 25/02/2036		1 444	1 408	0,00
4,889 % éch. 25/01/2036 ^		725	936	0,00
4,929 % éch. 25/10/2035		3 688	3 416	0,01
5,029 % éch. 25/04/2034		2	2	0,00
5,089 % éch. 25/10/2035		341	317	0,00
5,109 % éch. 25/08/2035		5 088	4 600	0,01
5,514 % éch. 25/01/2035		1 805	1 651	0,00
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
4,789 % éch. 25/10/2034		63	61	0,00
4,989 % éch. 25/12/2035 ^		2 987	1 551	0,00
5,125 % éch. 25/03/2034		403	407	0,00
5,500 % éch. 25/08/2035		2 175	1 456	0,00
5,500 % éch. 25/09/2035		203	179	0,00
5,750 % éch. 25/11/2034 ^		1 632	1 376	0,00
6,500 % éch. 25/03/2037		1 472	1 219	0,00
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				
4,529 % éch. 25/03/2037		2 503	2 099	0,00
4,549 % éch. 25/12/2046		3 003	2 543	0,01
4,549 % éch. 25/06/2047		2 878	2 336	0,01
4,559 % éch. 25/06/2047		6 917	5 634	0,01
4,569 % éch. 25/10/2036		1 011	837	0,00
4,579 % éch. 25/01/2037		6 087	5 180	0,01
4,789 % éch. 25/02/2037 ^		9 184	8 023	0,01
4,789 % éch. 25/09/2047		11 552	10 250	0,02
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				
3,523 % éch. 26/01/2036 ^		1 968	1 583	0,00
5,219 % éch. 26/12/2046 ^		2 030	1 465	0,00
BellaVista Mortgage Trust				
5,081 % éch. 22/01/2045		557	474	0,00
BNPP Mortgage Securities LLC Trust				
6,000 % éch. 27/08/2037		1 095	394	0,00
BX Trust				
6,288 % éch. 15/05/2035		662	635	0,00
7,593 % éch. 15/07/2034		29 499	29 059	0,05
8,693 % éch. 15/07/2034		3 304	3 249	0,01
BXP Trust				
3,379 % éch. 13/06/2039		90 000	80 255	0,14
Canada Square Funding PLC				
3,735 % éch. 17/01/2059	£	3 501	4 050	0,01
4,205 % éch. 17/06/2058		18 424	21 332	0,04
4,375 % éch. 17/06/2058		16 684	19 680	0,04
4,675 % éch. 17/12/2057		10 988	13 056	0,02
Canterbury Finance				
3,985 % éch. 16/05/2058		14 562	17 252	0,03
Canterbury Finance PLC				
4,595 % éch. 16/05/2056		2 672	3 210	0,01
5,245 % éch. 16/05/2056		4 450	5 337	0,01
5,645 % éch. 16/05/2056		3 756	4 504	0,01
Cascade Funding Mortgage Trust				
4,000 % éch. 25/10/2068	$	11 158	10 777	0,02
Chase Mortgage Finance Trust				
3,092 % éch. 25/02/2037		1 262	1 190	0,00
3,393 % éch. 25/03/2037 ^		3 095	2 824	0,01
3,643 % éch. 25/01/2036 ^		574	502	0,00
3,645 % éch. 25/02/2037		1 291	1 206	0,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
3,718 % éch. 25/07/2037	$ 531	$ 443	0,00
3,757 % éch. 25/02/2037	208	195	0,00
3,810 % éch. 25/07/2037	156	97	0,00
3,824 % éch. 25/12/2035 ^	2 151	1 950	0,00
3,824 % éch. 25/03/2037 ^	805	735	0,00
3,941 % éch. 25/12/2035 ^	95	81	0,00
5,250 % éch. 25/05/2035	1	1	0,00
5,500 % éch. 25/11/2035	2 226	1 657	0,00
6,000 % éch. 25/05/2036	2 852	1 391	0,00
6,000 % éch. 25/11/2036 ^	944	429	0,00
6,000 % éch. 25/05/2037 ^	2 557	1 336	0,00
ChaseFlex Trust			
4,450 % éch. 25/09/2036	619	540	0,00
4,689 % éch. 25/07/2037	6 726	6 452	0,01
5,000 % éch. 25/07/2037 ^	1 457	532	0,00
6,000 % éch. 25/02/2035	1 524	1 294	0,00
ChaseFlex Trust Multi-Class Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
4,112 % éch. 25/08/2037 ^	614	526	0,00
4,849 % éch. 25/08/2037 ^	5 857	5 176	0,01
Chester A PLC			
0,000 % éch. 17/03/2046 (e)(l)	£ 13 675	13 718	0,02
0,000 % éch. 20/05/2046	1	6 842	0,01
4,225 % éch. 17/03/2046 (l)	60 762	72 528	0,13
4,675 % éch. 17/03/2046 (l)	14 727	17 546	0,03
5,175 % éch. 17/03/2046 (l)	13 675	16 074	0,03
5,675 % éch. 17/03/2046 (l)	8 415	9 769	0,02
6,425 % éch. 17/03/2046 (l)	4 207	4 773	0,01
Chester B1 Issuer PLC			
4,185 % éch. 17/01/2058	20 776	24 953	0,04
4,485 % éch. 17/01/2058	4 045	4 842	0,01
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates			
3,682 % éch. 25/08/2035	$ 892	703	0,00
4,539 % éch. 25/01/2036	267	234	0,00
4,569 % éch. 25/05/2036	830	708	0,00
4,589 % éch. 25/01/2036	728	642	0,00
4,589 % éch. 25/10/2036	970	844	0,00
4,619 % éch. 25/10/2035	795	721	0,00
4,639 % éch. 25/08/2035	799	720	0,00
4,659 % éch. 25/05/2035	642	598	0,00
4,669 % éch. 25/01/2035	366	338	0,00
4,689 % éch. 25/08/2035	133	120	0,00
4,709 % éch. 25/05/2035	177	166	0,00
4,749 % éch. 25/03/2035	160	152	0,00
4,969 % éch. 25/10/2035	379	345	0,00
5,069 % éch. 25/10/2034	420	391	0,00
CIM Trust			
5,196 % éch. 25/09/2058	3 975	3 879	0,01
Citigroup Commercial Mortgage Trust			
0,283 % éch. 11/03/2047 (a)	25 416	75	0,00
3,518 % éch. 10/05/2035	7 410	6 759	0,01
6,243 % éch. 15/12/2036	3 000	2 864	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust			
2,414 % éch. 25/03/2037 ^	353	300	0,00
2,524 % éch. 25/03/2037 ^	4 272	3 536	0,01
2,742 % éch. 25/03/2036 ^	340	314	0,00
2,951 % éch. 20/02/2036	1 791	1 564	0,00
3,000 % éch. 25/02/2037	3 290	2 486	0,01
3,312 % éch. 25/08/2047 ^	238	209	0,00
3,330 % éch. 25/04/2036	788	473	0,00
3,437 % éch. 25/07/2036 ^	134	97	0,00
3,463 % éch. 25/03/2037 ^	1 342	1 171	0,00
3,482 % éch. 25/05/2042	1 054	948	0,00
3,535 % éch. 25/04/2037 ^	1 105	940	0,00
3,551 % éch. 25/06/2036 ^	1 437	1 317	0,00
3,595 % éch. 25/07/2037 ^	1 305	1 128	0,00
3,666 % éch. 25/07/2036 ^	1 728	1 302	0,00
3,840 % éch. 25/11/2036 ^	2 861	2 554	0,01
3,859 % éch. 25/10/2035 ^	82	72	0,00
3,871 % éch. 25/09/2037	2 309	1 971	0,00
3,885 % éch. 25/08/2035 ^	401	322	0,00
3,991 % éch. 25/11/2036	681	505	0,00
4,145 % éch. 25/01/2082	27 087	23 702	0,04
4,156 % éch. 25/08/2036	11 759	4 910	0,01
4,363 % éch. 25/09/2064	14 105	10 949	0,02
4,519 % éch. 25/06/2036	5 687	5 306	0,01
4,709 % éch. 25/09/2036	430	403	0,00
4,709 % éch. 25/01/2037	3 548	2 985	0,01
4,889 % éch. 25/09/2036	3 997	3 739	0,01
5,500 % éch. 25/09/2035	1 007	970	0,00
6,000 % éch. 25/12/2035	1 402	1 316	0,00
6,000 % éch. 25/11/2036	$ 46	$ 46	0,00
6,000 % éch. 25/08/2037	1 406	615	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
2,910 % éch. 25/05/2035	39	38	0,00
3,566 % éch. 25/04/2035	442	409	0,00
3,849 % éch. 25/12/2035 ^	537	353	0,00
4,024 % éch. 25/08/2035	2 328	1 718	0,00
5,750 % éch. 25/11/2035 ^	2 750	2 031	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc. Mortgage Pass-Through Certificates			
2,994 % éch. 25/09/2035 ^	1 422	1 210	0,00
CitiMortgage Alternative Loan Trust			
4,889 % éch. 25/05/2037	4 322	3 676	0,01
4,939 % éch. 25/01/2037	5 004	4 146	0,01
4,939 % éch. 25/02/2037 ^	1 555	1 265	0,00
4,989 % éch. 25/03/2037	2 669	2 262	0,00
5,039 % éch. 25/12/2036	1 829	1 473	0,00
5,500 % éch. 25/04/2036	241	214	0,00
5,750 % éch. 25/12/2036 ^	2 004	1 713	0,00
5,750 % éch. 25/03/2037	589	511	0,00
5,750 % éch. 25/04/2037	3 881	3 463	0,01
6,000 % éch. 25/07/2036	957	845	0,00
6,000 % éch. 25/09/2036	203	180	0,00
6,000 % éch. 25/10/2036 ^	220	193	0,00
6,000 % éch. 25/11/2036	3 385	2 905	0,01
6,000 % éch. 25/05/2037 ^	447	403	0,00
6,000 % éch. 25/06/2037	6 964	5 952	0,01
Commercial Mortgage Trust			
0,177 % éch. 10/04/2047 (a)	58 900	110	0,00
0,958 % éch. 10/08/2046 (a)	13 100	46	0,00
1,308 % éch. 10/10/2049 (a)	67 381	2 435	0,01
3,140 % éch. 10/10/2036	10 000	8 744	0,02
3,505 % éch. 10/08/2048	7 908	7 525	0,01
3,611 % éch. 10/08/2049	4 600	4 278	0,01
3,651 % éch. 10/02/2049	14 060	13 223	0,02
3,961 % éch. 10/05/2051	40 000	37 385	0,07
5,418 % éch. 15/09/2033	10 849	10 198	0,02
Countrywide Alternative Loan Resecuritization Trust			
6,000 % éch. 25/05/2036 ^	286	174	0,00
6,250 % éch. 25/08/2037	1 235	674	0,00
7,000 % éch. 25/01/2037 ^	287	64	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust			
2,111 % éch. 25/09/2037 (a)	850	149	0,00
2,561 % éch. 25/10/2037 ^(a)	1 576	311	0,00
2,890 % éch. 25/05/2035 ^	2 089	1 519	0,00
2,898 % éch. 25/11/2046	5 877	4 869	0,01
2,963 % éch. 25/04/2036 ^	245	204	0,00
2,988 % éch. 25/06/2046	4 919	3 921	0,01
3,045 % éch. 25/03/2047 ^	900	766	0,00
3,048 % éch. 25/12/2035	1 017	886	0,00
3,048 % éch. 25/02/2036	141	126	0,00
3,152 % éch. 25/03/2047	742	632	0,00
3,358 % éch. 20/07/2035 ^	92	77	0,00
3,377 % éch. 25/10/2035 ^	168	146	0,00
3,385 % éch. 25/06/2037 ^	7 474	6 241	0,01
3,398 % éch. 25/08/2035 ^	399	329	0,00
3,428 % éch. 25/11/2047 ^	4 457	3 596	0,01
3,448 % éch. 25/08/2035	747	672	0,00
3,648 % éch. 25/08/2035 ^	2 012	1 669	0,00
3,693 % éch. 25/06/2035	2 093	1 814	0,00
3,718 % éch. 25/07/2021 ^	4	4	0,00
3,954 % éch. 25/09/2034 ^	1 192	1 084	0,00
4,241 % éch. 25/09/2034	36	35	0,00
4,533 % éch. 20/02/2047 ^	1 829	1 388	0,00
4,543 % éch. 20/03/2047	5 283	4 195	0,01
4,548 % éch. 20/12/2046 ^	9 032	7 272	0,01
4,629 % éch. 25/06/2036	1 877	1 682	0,00
4,629 % éch. 25/12/2046	704	600	0,00
4,633 % éch. 20/09/2046	5 322	3 438	0,01
4,649 % éch. 25/03/2047 ^	4 682	3 478	0,01
4,669 % éch. 25/08/2037	7 387	6 428	0,01
4,669 % éch. 25/04/2047	5 973	5 198	0,01
4,689 % éch. 25/08/2035 ^	278	191	0,00
4,689 % éch. 25/11/2035 ^	1 207	130	0,00
4,709 % éch. 25/09/2047	3 587	3 100	0,01
4,729 % éch. 25/07/2046	0	15	0,00
4,729 % éch. 25/05/2047	3 621	3 054	0,01
4,739 % éch. 25/05/2036 ^	2 194	970	0,00
4,739 % éch. 25/10/2036 ^	1 503	731	0,00
4,739 % éch. 25/11/2036	5 487	4 469	0,01
4,749 % éch. 25/09/2046	2 008	1 725	0,00
4,749 % éch. 25/05/2047	308	259	0,00
4,749 % éch. 25/06/2047	$ 4 829	$ 3 874	0,01
4,759 % éch. 25/02/2037 ^	750	234	0,00
4,769 % éch. 25/07/2046 ^	1 881	1 795	0,00
4,769 % éch. 25/08/2046	15 080	12 044	0,02
4,773 % éch. 20/03/2046	5 409	4 222	0,01
4,773 % éch. 20/05/2046 ^	16 486	13 608	0,02
4,789 % éch. 25/05/2036	4 231	3 555	0,01
4,789 % éch. 25/12/2036 ^	4 173	916	0,00
4,789 % éch. 25/04/2037 ^	2 089	682	0,00
4,809 % éch. 25/07/2046	4 831	4 211	0,01
4,813 % éch. 20/07/2035	1 756	1 600	0,00
4,829 % éch. 25/09/2047	4 571	3 860	0,01
4,839 % éch. 25/09/2035 ^	2 009	1 242	0,00
4,849 % éch. 25/03/2036	3 235	3 186	0,01
4,849 % éch. 25/11/2036 ^	5 230	4 430	0,01
4,869 % éch. 25/07/2035	1 353	1 074	0,00
4,869 % éch. 25/01/2037	3 435	2 778	0,01
4,889 % éch. 25/05/2035 ^	3 214	2 482	0,01
4,889 % éch. 25/06/2035 ^	3 638	2 750	0,01
4,889 % éch. 25/12/2035	1 627	1 004	0,00
4,889 % éch. 25/07/2036 ^	2 339	1 044	0,00
4,889 % éch. 25/09/2036	113	51	0,00
4,889 % éch. 25/05/2037 ^	1 791	688	0,00
4,889 % éch. 25/05/2037	152	76	0,00
4,889 % éch. 25/06/2037	3 752	2 923	0,01
4,889 % éch. 25/09/2037	850	386	0,00
4,889 % éch. 25/07/2046	2 707	2 351	0,01
4,909 % éch. 25/07/2035	1 310	1 113	0,00
4,909 % éch. 25/12/2035	203	174	0,00
4,929 % éch. 25/01/2036	2 539	2 234	0,00
4,929 % éch. 25/07/2036	2 903	2 498	0,01
4,939 % éch. 25/08/2035 ^	3 034	2 564	0,01
4,949 % éch. 25/08/2035	3 284	2 806	0,01
4,949 % éch. 25/02/2037	5 052	4 104	0,01
4,949 % éch. 25/10/2046	7 678	6 766	0,01
4,949 % éch. 25/08/2047 ^	5 800	4 669	0,01
4,953 % éch. 20/11/2035	1 550	1 385	0,00
4,969 % éch. 25/02/2036 ^	1 156	1 013	0,00
4,989 % éch. 25/12/2035	1 845	1 467	0,00
4,989 % éch. 25/01/2036	1 391	1 232	0,00
4,989 % éch. 25/10/2036	648	271	0,00
4,993 % éch. 20/11/2035	7 230	5 931	0,01
5,000 % éch. 25/08/2035 ^	2 595	1 849	0,00
5,009 % éch. 25/08/2035 ^	1 438	1 225	0,00
5,013 % éch. 20/11/2035	9 522	8 357	0,02
5,029 % éch. 25/11/2035	850	674	0,00
5,069 % éch. 25/09/2035	642	381	0,00
5,089 % éch. 25/09/2035	4 707	4 160	0,01
5,089 % éch. 25/02/2036	3 179	2 081	0,00
5,089 % éch. 25/05/2036	4 358	2 069	0,00
5,139 % éch. 25/01/2036 ^	77	51	0,00
5,189 % éch. 25/12/2035 ^	339	291	0,00
5,250 % éch. 25/06/2035	737	573	0,00
5,250 % éch. 25/06/2035 ^	739	575	0,00
5,250 % éch. 25/10/2035	227	160	0,00
5,289 % éch. 25/12/2036 ^	779	262	0,00
5,489 % éch. 25/02/2036 ^	73	60	0,00
5,500 % éch. 25/04/2035	2 512	2 097	0,00
5,500 % éch. 25/05/2035	1 017	784	0,00
5,500 % éch. 25/06/2035 ^	894	523	0,00
5,500 % éch. 25/07/2035 ^	291	215	0,00
5,500 % éch. 25/09/2035 ^	4 884	3 642	0,01
5,500 % éch. 25/11/2035 ^	3 266	2 125	0,00
5,500 % éch. 25/11/2035	11	7	0,00
5,500 % éch. 25/12/2035 ^	3 301	2 900	0,01
5,500 % éch. 25/12/2035	5 536	3 816	0,01
5,500 % éch. 25/01/2036 ^	867	644	0,00
5,500 % éch. 25/02/2036	1 768	1 399	0,00
5,500 % éch. 25/02/2036 ^	1 714	1 152	0,00
5,500 % éch. 25/04/2036	534	418	0,00
5,500 % éch. 25/04/2037 ^	500	276	0,00
5,750 % éch. 25/07/2035 ^	121	78	0,00
5,750 % éch. 25/10/2035	532	390	0,00
5,750 % éch. 25/05/2036	3 295	1 424	0,00
5,750 % éch. 25/05/2036 ^	5 672	2 430	0,01
5,750 % éch. 25/03/2037 ^	987	568	0,00
5,750 % éch. 25/03/2037 ^	2 965	1 624	0,00
5,750 % éch. 25/03/2037	797	706	0,00
5,750 % éch. 25/06/2037	12 337	5 904	0,01
5,849 % éch. 25/11/2035	6 677	5 944	0,01
6,000 % éch. 25/03/2027 ^	22	22	0,00
6,000 % éch. 25/11/2034	3 827	3 734	0,01
6,000 % éch. 25/12/2034	764	679	0,00

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
6,000 % éch. 25/02/2035	$	1 390	$ 1 154	0,00
6,000 % éch. 25/08/2035 ^		56	27	0,00
6,000 % éch. 25/12/2035 ^		3 976	2 932	0,01
6,000 % éch. 25/01/2036 ^		2 107	1 509	0,00
6,000 % éch. 25/02/2036		1 810	1 558	0,00
6,000 % éch. 25/03/2036		3 279	1 550	0,00
6,000 % éch. 25/04/2036 ^		6 551	3 211	0,01
6,000 % éch. 25/04/2036		1 595	900	0,00
6,000 % éch. 25/05/2036 ^		42	19	0,00
6,000 % éch. 25/08/2036 ^		17 591	12 010	0,02
6,000 % éch. 25/10/2036 ^		4 759	2 746	0,01
6,000 % éch. 25/11/2036 ^		3 816	2 272	0,00
6,000 % éch. 25/12/2036 ^		2 110	635	0,00
6,000 % éch. 25/01/2037 ^		1 389	925	0,00
6,000 % éch. 25/02/2037 ^		10 772	4 323	0,01
6,000 % éch. 25/03/2037		1 906	777	0,00
6,000 % éch. 25/03/2037 ^		2 055	838	0,00
6,000 % éch. 25/04/2037 ^		6 990	4 103	0,01
6,000 % éch. 25/05/2037 ^		10 813	5 314	0,01
6,000 % éch. 25/07/2037		6 407	3 416	0,01
6,000 % éch. 25/08/2037 ^		15 921	8 308	0,02
6,000 % éch. 25/02/2047 ^		2 135	1 103	0,00
6,250 % éch. 25/11/2036 ^		410	205	0,00
6,500 % éch. 25/08/2032		8	8	0,00
6,500 % éch. 25/09/2037 ^		9 258	3 925	0,01
6,750 % éch. 25/10/2036 ^		1 407	412	0,00
7,000 % éch. 25/10/2037		5 674	2 162	0,00
7,500 % éch. 25/07/2036		1 906	1 598	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,869 % éch. 25/04/2036 ^		835	699	0,00
5,109 % éch. 25/11/2035		137	131	0,00
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
2,514 % éch. 25/02/2035		2 288	1 803	0,00
2,734 % éch. 20/01/2035		63	54	0,00
2,741 % éch. 20/07/2034		157	145	0,00
2,761 % éch. 25/05/2047		2 509	2 100	0,00
2,811 % éch. 25/05/2036 (a)		335	56	0,00
2,871 % éch. 25/04/2037 ^		1 745	1 546	0,00
2,980 % éch. 25/04/2035 ^		1 941	1 417	0,00
3,001 % éch. 20/05/2036		1 727	1 582	0,00
3,007 % éch. 25/03/2037		374	350	0,00
3,127 % éch. 20/06/2035		21	19	0,00
3,130 % éch. 20/03/2036		448	363	0,00
3,302 % éch. 20/04/2036		1 174	1 041	0,00
3,340 % éch. 20/06/2036		1 833	1 586	0,00
3,359 % éch. 25/01/2036 ^		194	181	0,00
3,366 % éch. 20/05/2036 ^		1 183	1 038	0,00
3,490 % éch. 20/12/2035		47	44	0,00
3,501 % éch. 20/09/2036 ^		2 377	2 059	0,00
3,569 % éch. 20/09/2035		86	70	0,00
3,585 % éch. 20/12/2035		356	322	0,00
3,645 % éch. 25/11/2037		1 535	1 405	0,00
3,677 % éch. 20/02/2036		2 588	2 068	0,00
3,680 % éch. 25/08/2034 ^		10	9	0,00
3,710 % éch. 20/04/2035		121	117	0,00
3,716 % éch. 20/09/2035		1 486	1 316	0,00
3,774 % éch. 20/10/2034		444	390	0,00
3,792 % éch. 20/02/2036		878	758	0,00
3,802 % éch. 25/11/2037		1 695	1 469	0,00
3,909 % éch. 20/04/2035		559	516	0,00
4,084 % éch. 25/08/2034 ^		424	374	0,00
4,241 % éch. 20/10/2034		230	198	0,00
4,689 % éch. 25/05/2036		335	113	0,00
4,789 % éch. 25/08/2035		2 378	1 658	0,00
4,789 % éch. 25/09/2037 ^		4 102	1 848	0,00
4,789 % éch. 25/04/2046		1 736	1 424	0,00
4,869 % éch. 25/03/2036		3 846	3 329	0,01
4,969 % éch. 25/04/2035		1 285	1 114	0,00
5,009 % éch. 25/03/2035		102	87	0,00
5,029 % éch. 25/03/2035		1 488	1 254	0,00
5,049 % éch. 25/02/2035		2 158	1 684	0,00
5,069 % éch. 25/04/2046		6 827	2 048	0,00
5,089 % éch. 25/02/2035		2 992	2 523	0,01
5,109 % éch. 25/03/2035		781	648	0,00
5,129 % éch. 25/02/2035		2 595	2 157	0,00
5,149 % éch. 25/09/2034		121	113	0,00
5,500 % éch. 25/05/2035		588	477	0,00
5,500 % éch. 25/09/2035 ^		436	372	0,00
5,500 % éch. 25/10/2035 ^		928	572	0,00
5,500 % éch. 25/11/2035 ^		496	307	0,00
5,750 % éch. 25/12/2035 ^		1 358	728	0,00
5,750 % éch. 25/06/2037		1 956	1 058	0,00
5,850 % éch. 25/05/2036 ^	$	262	$ 125	0,00
6,000 % éch. 25/04/2036		1 155	641	0,00
6,000 % éch. 25/05/2036		2 229	1 086	0,00
6,000 % éch. 25/07/2036		2 510	1 430	0,00
6,000 % éch. 25/02/2037 ^		41	21	0,00
6,000 % éch. 25/02/2037		1 462	767	0,00
6,000 % éch. 25/03/2037		1 333	677	0,00
6,000 % éch. 25/03/2037 ^		2 708	1 352	0,00
6,000 % éch. 25/04/2037 ^		711	385	0,00
6,000 % éch. 25/04/2037		2 024	1 091	0,00
6,000 % éch. 25/05/2037 ^		8 708	4 183	0,01
6,000 % éch. 25/07/2037 ^		31	15	0,00
6,000 % éch. 25/07/2037		1 089	524	0,00
6,000 % éch. 25/08/2037		3 430	1 705	0,00
6,000 % éch. 25/10/2037		1 321	1 002	0,00
6,000 % éch. 25/01/2038 ^		6 811	3 288	0,01
6,250 % éch. 25/09/2036 ^		476	204	0,00
6,500 % éch. 25/12/2037		4 822	2 236	0,00
6,537 % éch. 20/02/2036 ^		1 772	1 607	0,00
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				
4,310 % éch. 25/01/2034 ^		197	158	0,00
6,000 % éch. 25/03/2035 ^		337	316	0,00
Countrywide Mortgage-Backed Securities, Inc.				
5,945 % éch. 27/11/2035		284	270	0,00
Countrywide, Inc.				
5,693 % éch. 27/11/2035		0	0	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
3,205 % éch. 25/03/2033		73	71	0,00
3,456 % éch. 25/06/2046		26 090	23 764	0,04
5,000 % éch. 25/07/2035 ^		612	547	0,00
5,500 % éch. 25/07/2035		1 842	1 644	0,00
6,000 % éch. 25/12/2035		1 877	864	0,00
6,500 % éch. 25/12/2035 ^		439	234	0,00
7,000 % éch. 25/12/2035 ^		1 296	265	0,00
7,000 % éch. 25/01/2036 ^		4 851	786	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates				
4,053 % éch. 25/10/2033		5	5	0,00
5,589 % éch. 25/07/2035		2 211	2 084	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				
3,249 % éch. 26/06/2036		3 406	2 814	0,01
3,276 % éch. 30/11/2037		7 779	7 121	0,01
3,340 % éch. 27/02/2046		6 479	3 522	0,01
3,476 % éch. 27/01/2036		3 320	3 127	0,01
3,524 % éch. 27/07/2037		750	718	0,00
3,758 % éch. 26/08/2036		4 567	3 889	0,01
3,792 % éch. 27/02/2036		2 499	1 782	0,00
4,020 % éch. 27/07/2037		1 057	908	0,00
4,186 % éch. 27/11/2036		13 768	15 998	0,03
4,296 % éch. 27/10/2036		9 339	6 867	0,01
5,750 % éch. 26/12/2035		415	300	0,00
6,000 % éch. 25/07/2037 ^		911	753	0,00
13,782 % éch. 27/11/2037		726	723	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				
5,500 % éch. 25/08/2036 ^		1 241	891	0,00
5,942 % éch. 25/02/2037 ^		1 057	270	0,00
6,000 % éch. 25/10/2021 ^		11	5	0,00
6,000 % éch. 25/03/2036 ^		2 958	1 323	0,00
6,396 % éch. 25/04/2036		285	156	0,00
6,421 % éch. 25/10/2037		4 459	2 755	0,01
Credit Suisse Mortgage Capital Trust				
2,436 % éch. 25/09/2057		1 289	1 122	0,00
2,500 % éch. 25/07/2057		62 177	54 245	0,09
2,823 % éch. 25/09/2048		13 282	11 345	0,02
3,075 % éch. 25/02/2056		160 999	129 197	0,22
3,078 % éch. 25/07/2057		52 971	31 227	0,06
3,266 % éch. 25/07/2058		284 005	220 756	0,38
3,451 % éch. 25/06/2048		49 890	41 374	0,07
3,726 % éch. 25/10/2058		546	464	0,00
3,999 % éch. 25/04/2058		53 920	45 934	0,08
4,006 % éch. 01/06/2050		112 695	113 381	0,20
4,283 % éch. 25/09/2057		30 610	26 472	0,05
4,390 % éch. 25/12/2048		12 959	11 101	0,02
5,068 % éch. 15/07/2032		48 000	45 271	0,08
5,318 % éch. 15/07/2032		22 200	20 704	0,04
DBWF Mortgage Trust				
6,839 % éch. 19/12/2030		9 300	8 909	0,02
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust				
4,529 % éch. 25/07/2047		9 516	8 372	0,02
4,589 % éch. 25/08/2047		2 899	2 509	0,01
4,629 % éch. 25/08/2036 ^	$	540	$ 484	0,00
4,649 % éch. 25/08/2047		5 709	4 936	0,01
4,689 % éch. 25/03/2037 ^		6 336	5 903	0,01
4,689 % éch. 25/09/2047 ^		11 557	9 770	0,02
4,709 % éch. 25/03/2037		14 238	7 859	0,01
4,719 % éch. 25/08/2037 ^		12 870	10 901	0,02
4,749 % éch. 25/01/2047		2 142	1 910	0,00
4,769 % éch. 25/10/2036 ^		16 170	5 501	0,01
4,769 % éch. 25/12/2036		1 985	714	0,00
4,769 % éch. 25/02/2037 ^		2 557	2 193	0,00
4,769 % éch. 25/08/2047		6 121	5 285	0,01
4,869 % éch. 25/01/2047		2 836	2 347	0,01
4,949 % éch. 25/08/2036		3 635	3 280	0,01
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				
2,693 % éch. 25/08/2035 ^		674	594	0,00
3,433 % éch. 25/10/2035		2 111	1 843	0,00
3,792 % éch. 25/02/2036 ^		369	263	0,00
4,589 % éch. 25/11/2035 ^		2	1	0,00
4,779 % éch. 25/11/2035		863	819	0,00
5,500 % éch. 25/12/2035 ^		670	537	0,00
Deutsche ALT-B Securities Mortgage Loan Trust				
6,005 % éch. 25/10/2036 ^		1 400	1 224	0,00
6,445 % éch. 25/02/2036 ^		3 955	3 571	0,01
Deutsche ALT-B Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				
4,839 % éch. 25/06/2036		259	214	0,00
4,839 % éch. 25/06/2036 ^		1 946	1 607	0,00
Deutsche Mortgage & Asset Receiving Corp.				
6,500 % éch. 27/07/2037		559	445	0,00
Deutsche Mortgage Securities, Inc. Mortgage Loan Trust				
5,364 % éch. 25/06/2034		421	419	0,00
Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates				
3,464 % éch. 27/06/2037		531	459	0,00
Domi BV				
2,896 % éch. 15/06/2051	€	6 266	6 630	0,01
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				
4,529 % éch. 19/10/2036	$	6 278	5 037	0,01
4,539 % éch. 19/10/2036		3 984	2 718	0,01
4,919 % éch. 19/10/2045		3 266	2 703	0,01
5,079 % éch. 19/10/2045		2 904	2 582	0,01
5,159 % éch. 19/09/2044		7	6	0,00
Dragon Finance BV				
4,221 % éch. 13/07/2023	£	1 299	1 523	0,00
Dutch Property Finance BV				
2,228 % éch. 28/07/2054	€	15 397	16 262	0,03
Eurohome UK Mortgages PLC				
3,872 % éch. 15/09/2044	£	6 850	7 468	0,01
3,946 % éch. 15/06/2044		4 139	4 750	0,01
4,122 % éch. 15/09/2044		7 250	7 348	0,01
European Loan Conduit DAC				
2,502 % éch. 23/04/2029	€	237	252	0,00
2,803 % éch. 17/02/2030		65 520	66 886	0,12
Eurosail PLC				
2,165 % éch. 13/03/2045		89	94	0,00
2,245 % éch. 13/03/2045		5 450	5 612	0,01
2,286 % éch. 15/12/2044		945	968	0,00
2,440 % éch. 10/09/2044		3 200	3 165	0,01
3,661 % éch. 13/03/2045	£	1 774	2 097	0,00
3,671 % éch. 13/03/2045		5	6	0,00
3,954 % éch. 10/09/2044		1 200	1 341	0,00
4,281 % éch. 13/09/2045		13 827	15 420	0,03
4,461 % éch. 13/06/2045		12 390	14 675	0,03
4,511 % éch. 13/06/2045		1 421	1 513	0,00
Fingal Securities RMBS DAC				
3,078 % éch. 28/07/2055	€	32 308	34 377	0,06
Finsbury Square PLC				
4,209 % éch. 16/12/2071	£	4 307	5 043	0,01
4,419 % éch. 16/12/2069		12 042	14 481	0,03
4,709 % éch. 16/06/2070		15 300	18 368	0,03
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust				
3,530 % éch. 25/09/2035 ^	$	171	143	0,00
3,605 % éch. 25/03/2035		632	399	0,00
3,766 % éch. 25/11/2035 ^		1 419	953	0,00
3,865 % éch. 25/02/2036		115	88	0,00
3,991 % éch. 25/11/2036 ^		859	618	0,00
4,023 % éch. 25/02/2037 ^		400	232	0,00
4,177 % éch. 25/01/2037 ^		864	646	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
5,500 % éch. 25/11/2035	$	72	$ 39	0,00
6,000 % éch. 25/05/2036 ^		702	321	0,00
6,000 % éch. 25/02/2037 ^		759	327	0,00
First Horizon Asset Securities, Inc.				
3,721 % éch. 25/01/2036 ^		28	17	0,00
First Horizon Mortgage Pass-Through Trust				
3,390 % éch. 25/11/2036 ^		392	275	0,00
3,801 % éch. 25/08/2037 ^		241	85	0,00
3,857 % éch. 25/07/2037 ^		241	159	0,00
4,267 % éch. 25/09/2035		5	5	0,00
4,282 % éch. 25/11/2037 ^		466	401	0,00
6,000 % éch. 25/05/2036		177	88	0,00
6,000 % éch. 25/08/2037 ^		247	105	0,00
FirstMac Mortgage Funding Trust				
4,056 % éch. 08/03/2049	AUD	2 981	2 020	0,00
Fondo de Titulizacion de Activos UCI				
2,231 % éch. 16/06/2049	€	12 139	12 202	0,02
FWD Securitization Trust				
2,240 % éch. 25/01/2050	$	7 175	6 410	0,01
2,810 % éch. 25/06/2049		1 801	1 663	0,00
GC Pastor Hipotecario FTA				
2,233 % éch. 21/06/2046	€	1 489	1 343	0,00
Glen Securities Finance DAC				
3,678 % éch. 28/10/2038		3 828	3 976	0,01
4,678 % éch. 28/10/2038		2 892	2 958	0,01
5,478 % éch. 28/10/2038		1 382	1 416	0,00
Glenbeigh Issuer DAC				
2,875 % éch. 24/06/2050		4 162	4 316	0,01
GMAC Commercial Mortgage Asset Corp.				
5,456 % éch. 10/03/2051	$	18 302	16 074	0,03
5,550 % éch. 10/08/2038		19 413	18 409	0,03
GMAC Mortgage Corp. Loan Trust				
0,000 % éch. 18/03/2035		16	13	0,00
2,985 % éch. 19/04/2036 ^		306	231	0,00
3,348 % éch. 19/11/2035 ^		59	50	0,00
4,750 % éch. 19/07/2035		153	129	0,00
Great Hall Mortgages PLC				
2,592 % éch. 18/06/2039	€	800	734	0,00
3,675 % éch. 18/03/2039	£	4 556	5 406	0,01
3,685 % éch. 18/06/2039		125	147	0,00
3,695 % éch. 18/06/2038		3 232	3 832	0,01
4,868 % éch. 18/06/2039	$	253	248	0,00
Greenpoint Mortgage Funding Trust				
4,789 % éch. 25/10/2046		7 427	6 549	0,01
4,809 % éch. 25/04/2036		304	253	0,00
4,829 % éch. 25/06/2045		719	656	0,00
4,909 % éch. 25/10/2045		3 554	3 438	0,01
4,969 % éch. 25/02/2036		1 556	1 315	0,00
5,009 % éch. 25/10/2045		2 485	2 195	0,00
Grifonas Finance PLC				
1,264 % éch. 28/08/2039	€	20 441	19 829	0,04
GS Mortgage Securities Corp. Trust				
3,419 % éch. 10/10/2032	$	7 532	7 337	0,01
4,591 % éch. 10/10/2032		35 288	33 632	0,06
6,118 % éch. 15/07/2025		12 349	11 923	0,02
7,318 % éch. 15/11/2032		19 350	18 150	0,03
GSC Capital Corp. Mortgage Trust				
4,789 % éch. 25/02/2036 ^		1 837	1 650	0,00
GSMPS Mortgage Loan Trust				
3,599 % éch. 25/06/2034		4 695	4 273	0,01
4,739 % éch. 25/03/2035		6 430	6 068	0,01
4,739 % éch. 25/09/2035		7 390	6 362	0,01
4,789 % éch. 25/06/2034		1 427	1 233	0,00
7,058 % éch. 20/10/2032		1 316	1 136	0,00
GSMSC Resecuritization Trust				
3,544 % éch. 26/04/2037		9 344	2 699	0,01
3,999 % éch. 26/08/2035		114	113	0,00
4,196 % éch. 26/09/2036		8 322	5 590	0,01
GSR Mortgage Loan Trust				
2,994 % éch. 25/05/2037 ^		1 324	755	0,00
3,110 % éch. 25/04/2036 ^		3 761	2 583	0,01
3,395 % éch. 25/10/2035 ^		99	90	0,00
3,796 % éch. 25/01/2036		860	827	0,00
3,904 % éch. 25/05/2037		3 600	3 296	0,01
4,222 % éch. 25/05/2037 ^		125	108	0,00
4,619 % éch. 25/05/2037		12 471	6 958	0,01
4,829 % éch. 25/08/2046		18 042	4 368	0,01
5,500 % éch. 25/07/2035	$	500	$ 458	0,00
5,750 % éch. 25/03/2036 ^		246	224	0,00
5,750 % éch. 25/05/2037 ^		175	340	0,00
6,000 % éch. 25/02/2036		1 856	974	0,00
6,000 % éch. 25/07/2036		1 968	1 191	0,00
6,000 % éch. 25/07/2037 ^		463	325	0,00
6,250 % éch. 25/08/2036		1 145	420	0,00
6,500 % éch. 25/05/2036		968	320	0,00
6,530 % éch. 25/05/2034		25	21	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust				
2,898 % éch. 19/12/2036 ^		1 895	1 554	0,00
3,275 % éch. 19/07/2035 ^		20	15	0,00
3,329 % éch. 19/06/2036 ^		2 196	1 165	0,00
3,490 % éch. 19/11/2034		343	324	0,00
3,548 % éch. 19/09/2035 ^		114	99	0,00
3,720 % éch. 25/02/2036 ^		147	48	0,00
3,928 % éch. 19/12/2035 ^		573	538	0,00
4,048 % éch. 19/10/2035		6 784	4 013	0,01
4,048 % éch. 19/01/2036 ^		987	440	0,00
4,519 % éch. 19/11/2036		17 873	15 686	0,03
4,519 % éch. 19/11/2046 ^		905	641	0,00
4,529 % éch. 19/09/2037		9 196	7 900	0,01
4,599 % éch. 19/03/2037		1 118	988	0,00
4,639 % éch. 25/01/2047		12 367	10 602	0,02
4,679 % éch. 19/12/2036 ^		615	530	0,00
4,719 % éch. 19/01/2038		10 225	8 987	0,02
4,749 % éch. 19/12/2036		37 098	30 592	0,05
4,759 % éch. 19/11/2036		14 592	12 014	0,02
4,779 % éch. 19/05/2035		3 024	2 693	0,01
4,839 % éch. 19/01/2036		3 248	1 981	0,00
4,879 % éch. 19/03/2035		632	608	0,00
4,913 % éch. 20/10/2045		3 875	2 363	0,01
4,939 % éch. 19/04/2034		78	71	0,00
4,959 % éch. 19/09/2035		8 708	4 539	0,01
4,959 % éch. 19/11/2035		315	241	0,00
4,979 % éch. 19/08/2045		2 558	1 938	0,00
5,019 % éch. 19/01/2035		164	157	0,00
5,389 % éch. 25/10/2037		12 760	11 335	0,02
5,879 % éch. 19/02/2036		1 885	1 027	0,00
Harbour Energy PLC				
3,844 % éch. 28/01/2054	£	23 400	27 703	0,05
3,944 % éch. 28/01/2054		14 500	16 628	0,03
Hilton Orlando Trust				
8,218 % éch. 15/12/2034	$	2 213	2 087	0,00
Hipocat FTA				
1,642 % éch. 24/10/2039	€	2 218	2 322	0,01
HomeBanc Mortgage Trust				
2,663 % éch. 25/04/2037	$	713	624	0,00
3,341 % éch. 25/04/2047		1 108	950	0,00
4,909 % éch. 25/01/2036		782	735	0,00
5,124 % éch. 25/01/2036		8 088	6 574	0,01
Hops Hill PLC				
4,382 % éch. 27/05/2054	£	27 252	32 464	0,06
HSI Asset Loan Obligation Trust				
2,241 % éch. 25/12/2036 (a)	$	1 500	158	0,00
4,759 % éch. 25/12/2036		1 937	399	0,00
IM Pastor Fondo de Titluzacion Hipotecaria				
2,261 % éch. 22/09/2041	€	29	31	0,00
Impac CMB Trust				
4,929 % éch. 25/05/2035	$	191	176	0,00
5,029 % éch. 25/11/2034		1 251	1 208	0,00
5,029 % éch. 25/03/2035		2 807	2 548	0,01
5,069 % éch. 25/01/2035		2 149	2 008	0,00
6,060 % éch. 25/10/2034		352	372	0,00
Impac Secured Assets CMN Owner Trust				
5,450 % éch. 25/03/2033		259	247	0,00
Impac Secured Assets Corp.				
5,029 % éch. 25/03/2036		1 426	1 122	0,00
5,814 % éch. 25/02/2035		514	512	0,00
Impac Secured Assets Trust				
4,609 % éch. 25/05/2037 ^		595	458	0,00
4,789 % éch. 25/11/2036		887	871	0,00
4,869 % éch. 25/09/2037 ^		2 912	2 376	0,01
4,909 % éch. 25/01/2037		9 381	8 036	0,01
4,929 % éch. 25/11/2036		6 459	4 799	0,01
4,929 % éch. 25/02/2037 ^		5 210	4 664	0,01
5,089 % éch. 25/05/2036		403	343	0,00
5,109 % éch. 25/09/2037		2 484	1 994	0,00
IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,686 % éch. 25/01/2032		1	1	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust				
2,647 % éch. 25/09/2035 ^	$	76	$ 65	0,00
2,808 % éch. 25/05/2035 ^		73	52	0,00
2,824 % éch. 25/06/2037 ^		3 211	2 594	0,01
2,887 % éch. 25/06/2037 ^		1 791	1 602	0,00
2,892 % éch. 25/05/2035 ^		268	212	0,00
3,014 % éch. 25/03/2037 ^		17	14	0,00
3,024 % éch. 25/07/2037		7 254	6 190	0,01
3,025 % éch. 25/05/2037 ^		1 589	1 270	0,00
3,082 % éch. 25/03/2036 ^		3 524	2 481	0,01
3,122 % éch. 25/06/2036		5 627	3 736	0,01
3,187 % éch. 25/11/2035 ^		37	26	0,00
3,190 % éch. 25/04/2037		6 991	5 871	0,01
3,197 % éch. 25/05/2037 ^		2 049	1 364	0,00
3,229 % éch. 25/08/2035		66	53	0,00
3,243 % éch. 25/04/2037		3 675	3 015	0,01
3,244 % éch. 25/09/2036 ^		129	106	0,00
3,259 % éch. 25/08/2037 ^		4 817	3 651	0,01
3,266 % éch. 25/09/2036 ^		117	99	0,00
3,318 % éch. 25/05/2036 ^		155	124	0,00
3,324 % éch. 25/06/2037 ^		6 377	4 404	0,01
3,333 % éch. 25/08/2037		2 847	1 930	0,00
3,337 % éch. 25/07/2036		3 404	2 557	0,01
3,380 % éch. 25/08/2036		172	136	0,00
3,413 % éch. 25/09/2035 ^		301	208	0,00
3,453 % éch. 25/11/2035 ^		1 516	1 248	0,00
3,530 % éch. 25/12/2035		3 672	2 820	0,01
3,535 % éch. 25/09/2036		1 483	1 020	0,00
3,546 % éch. 25/09/2037		13 447	10 349	0,02
3,657 % éch. 25/01/2037 ^		162	131	0,00
3,817 % éch. 25/08/2034		84	77	0,00
4,549 % éch. 25/04/2037		977	821	0,00
4,579 % éch. 25/04/2037		1 643	1 382	0,00
4,629 % éch. 25/07/2036		4 758	4 230	0,01
4,639 % éch. 25/09/2037		4 356	3 916	0,01
4,649 % éch. 25/10/2036		2 696	2 336	0,01
4,729 % éch. 25/01/2037 ^		8 338	6 938	0,01
4,739 % éch. 25/06/2036		2 966	2 333	0,01
4,749 % éch. 25/08/2036		8 449	5 850	0,01
4,749 % éch. 25/02/2037 ^		5 907	5 194	0,01
4,749 % éch. 25/07/2047		3 529	2 433	0,01
4,769 % éch. 25/10/2036		5 181	2 389	0,01
4,789 % éch. 25/06/2046		6 002	4 667	0,01
4,789 % éch. 25/11/2046		7 504	6 542	0,01
4,809 % éch. 25/11/2036		162	149	0,00
4,809 % éch. 25/04/2046		2 736	2 252	0,00
4,809 % éch. 25/05/2046		7 849	6 850	0,01
4,829 % éch. 25/04/2046		394	324	0,00
4,849 % éch. 25/04/2035		284	255	0,00
4,889 % éch. 25/11/2036		3 834	3 652	0,01
4,909 % éch. 25/07/2035		5 879	4 057	0,01
4,929 % éch. 25/10/2036		2 111	990	0,00
4,969 % éch. 25/01/2036		3 122	2 114	0,00
4,989 % éch. 25/07/2035		1 134	922	0,00
5,169 % éch. 25/12/2034		861	657	0,00
5,189 % éch. 25/07/2046		4 658	3 898	0,01
5,209 % éch. 25/11/2034 ^		1 025	847	0,00
5,249 % éch. 25/09/2034		44	37	0,00
6,000 % éch. 25/07/2037 ^		697	517	0,00
6,000 % éch. 25/08/2037 ^		194	84	0,00
6,000 % éch. 25/08/2037		781	337	0,00
6,500 % éch. 25/07/2037 ^		369	120	0,00
6,500 % éch. 25/09/2037 ^		1 836	1 148	0,00
6,500 % éch. 25/10/2037		2 701	1 512	0,00
JPMorgan Alternative Loan Trust				
3,019 % éch. 25/03/2036		744	627	0,00
3,326 % éch. 25/10/2036		4 520	3 807	0,01
3,699 % éch. 25/03/2037 ^		982	871	0,00
3,768 % éch. 25/01/2036		373	250	0,00
4,749 % éch. 25/05/2036		570	474	0,00
4,909 % éch. 25/01/2036		5	5	0,00
4,949 % éch. 25/06/2037		18 353	7 923	0,01
4,949 % éch. 25/04/2047		3 488	3 313	0,01
5,843 % éch. 26/05/2037		2 868	2 229	0,00
6,000 % éch. 27/12/2036		1 141	610	0,00
6,180 % éch. 25/03/2036		6 874	5 726	0,01
6,210 % éch. 25/12/2036 ^		157	150	0,00
6,460 % éch. 25/12/2036 ^		1 054	1 001	0,00
6,550 % éch. 25/05/2036		116	115	0,00
6,620 % éch. 25/08/2036 ^		218	206	0,00
6,920 % éch. 25/08/2036 ^		3 925	2 969	0,01
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Corp.				
5,268 % éch. 15/02/2035		35 550	34 523	0,06

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				
1,220 % éch. 15/04/2046 (a)	$	10 429	$ 5	0,00
3,756 % éch. 05/01/2031		19 450	19 424	0,03
4,549 % éch. 05/07/2033		3 809	3 392	0,01
4,950 % éch. 05/07/2033		38 900	34 244	0,06
5,337 % éch. 15/05/2047		1 720	1 607	0,00
5,350 % éch. 05/07/2033		9 940	8 671	0,02
5,418 % éch. 15/12/2036		17 100	15 868	0,03
6,072 % éch. 05/07/2033		10 109	9 168	0,02
JPMorgan Mortgage Trust				
2,885 % éch. 25/05/2036 ^		42	35	0,00
3,051 % éch. 25/04/2036 ^		3 013	2 577	0,01
3,085 % éch. 25/06/2034		14	13	0,00
3,196 % éch. 27/07/2037		479	436	0,00
3,230 % éch. 25/04/2037 ^		3	2	0,00
3,284 % éch. 25/05/2037		1 474	1 272	0,00
3,323 % éch. 25/08/2036		3 828	3 169	0,01
3,349 % éch. 25/05/2036		1 402	1 144	0,00
3,375 % éch. 25/05/2036		2 996	2 520	0,01
3,427 % éch. 25/05/2037 ^		398	344	0,00
3,460 % éch. 25/08/2036		108	81	0,00
3,532 % éch. 25/04/2035 ^		321	292	0,00
3,590 % éch. 25/10/2036		255	190	0,00
3,608 % éch. 25/08/2035		806	792	0,00
3,678 % éch. 25/08/2035 ^		187	159	0,00
3,703 % éch. 25/07/2035		290	260	0,00
3,763 % éch. 25/11/2035 ^		1 825	1 493	0,00
3,848 % éch. 25/01/2037 ^		747	579	0,00
3,879 % éch. 25/11/2035 ^		789	687	0,00
3,879 % éch. 25/11/2035		2 605	2 270	0,00
4,042 % éch. 25/10/2037		3 020	2 473	0,01
4,108 % éch. 25/09/2035		416	383	0,00
5,500 % éch. 25/07/2036		3 042	1 832	0,00
5,750 % éch. 25/01/2036 ^		981	488	0,00
5,875 % éch. 25/06/2021 ^		4	16	0,00
6,000 % éch. 25/08/2037		2 667	1 480	0,00
6,000 % éch. 25/08/2037 ^		4 896	2 718	0,01
6,250 % éch. 25/08/2037		5 122	1 705	0,00
6,500 % éch. 25/01/2035		1 423	1 410	0,00
6,500 % éch. 25/07/2036 ^		234	105	0,00
6,500 % éch. 25/08/2036		4 392	1 836	0,00
JPMorgan Resecuritization Trust				
4,437 % éch. 26/09/2036		262	235	0,00
4,512 % éch. 26/04/2037		1 413	737	0,00
5,319 % éch. 26/09/2037		1 350	1 018	0,00
5,750 % éch. 26/05/2037		127	59	0,00
6,000 % éch. 26/09/2036		548	414	0,00
Kinbane DAC				
2,744 % éch. 25/09/2062	€	46 380	47 259	0,08
Kirkby RMBS PLC				
0,000 % éch. 22/02/2045	£	1	3 110	0,01
2,250 % éch. 22/02/2045		4 258	1 150	0,00
4,197 % éch. 22/02/2045		31 333	36 107	0,06
5,397 % éch. 22/02/2045		13 150	14 411	0,03
Landmark Mortgage Securities PLC				
2,282 % éch. 17/06/2038	€	27	28	0,00
3,066 % éch. 17/06/2039	£	5 817	6 580	0,01
3,764 % éch. 17/06/2038		168	199	0,00
Lanebrook Mortgage Transaction PLC				
4,487 % éch. 12/06/2057		16 193	19 380	0,03
Lansdowne Mortgage Securities PLC				
2,346 % éch. 15/06/2045	€	3 425	3 517	0,01
Legacy Mortgage Asset Trust				
0,000 % éch. 25/12/2056 (a)	$	120 409	858	0,00
0,125 % éch. 26/12/2057 (a)		71 900	346	0,00
0,400 % éch. 26/12/2057 (a)		22 759	302	0,00
3,011 % éch. 25/12/2056		120 401	98 408	0,17
3,369 % éch. 26/08/2058		17 864	13 260	0,02
3,650 % éch. 26/12/2057		48 440	38 428	0,07
3,758 % éch. 25/01/2058		22 814	20 152	0,04
4,000 % éch. 25/02/2058		2 501	2 451	0,01
4,000 % éch. 26/08/2058		14 589	14 465	0,03
4,028 % éch. 25/02/2058		1 575	1 089	0,00
4,250 % éch. 25/02/2058		1 575	1 495	0,00
4,250 % éch. 26/08/2058		35 727	33 987	0,06
4,500 % éch. 25/02/2058		1 575	1 435	0,00
Lehman Mortgage Trust				
4,889 % éch. 25/07/2037 ^		456	383	0,00
5,289 % éch. 25/12/2035 ^		616	380	0,00
5,750 % éch. 25/01/2037		309	193	0,00
6,000 % éch. 25/01/2036		2 406	563	0,00
6,000 % éch. 25/07/2036	$	668	$ 347	0,00
6,000 % éch. 25/12/2036		1 176	961	0,00
Lehman XS Trust				
3,048 % éch. 25/11/2035		121	118	0,00
3,548 % éch. 25/03/2047		3 004	2 506	0,01
4,629 % éch. 25/08/2036 ^		54	54	0,00
4,659 % éch. 25/02/2036		332	289	0,00
4,689 % éch. 25/11/2035		5 535	5 363	0,01
4,769 % éch. 25/12/2036		6 783	5 153	0,01
4,769 % éch. 25/09/2046		133	111	0,00
4,789 % éch. 25/08/2046		4 470	3 999	0,01
4,789 % éch. 25/11/2046 ^		799	711	0,00
4,789 % éch. 25/03/2047		15 134	12 422	0,02
4,789 % éch. 25/06/2047 ^		5 910	4 795	0,01
4,799 % éch. 25/08/2046		9 192	8 081	0,01
4,809 % éch. 25/11/2046		13 793	11 781	0,02
4,829 % éch. 25/06/2047		6 092	5 436	0,01
4,889 % éch. 25/08/2037		3 254	2 912	0,01
4,909 % éch. 25/02/2046 ^		8 981	7 789	0,01
4,944 % éch. 25/08/2047 ^		10 361	8 900	0,02
6,089 % éch. 25/09/2047		1 546	1 288	0,00
London Wall Mortgage Capital PLC				
4,040 % éch. 15/05/2052	£	9 977	11 605	0,02
Ludgate Funding PLC				
1,320 % éch. 01/01/2061	€	8 174	8 130	0,02
1,860 % éch. 01/01/2061		11 081	11 031	0,02
2,274 % éch. 01/12/2060		1 800	1 719	0,00
2,372 % éch. 01/01/2061		874	847	0,00
2,442 % éch. 01/01/2061		2 914	2 796	0,01
3,490 % éch. 01/01/2061	£	5 249	5 915	0,01
3,570 % éch. 01/01/2061		6 410	7 030	0,01
3,869 % éch. 01/12/2060		1 043	1 179	0,00
3,930 % éch. 01/01/2061		11 893	13 530	0,02
3,979 % éch. 01/12/2060		2 348	2 516	0,01
Luminent Mortgage Trust				
4,669 % éch. 25/01/2037 ^	$	2 395	1 965	0,00
4,729 % éch. 25/12/2036		2 375	2 040	0,00
4,749 % éch. 25/12/2036 ^		103	93	0,00
4,769 % éch. 25/05/2046		890	725	0,00
4,789 % éch. 25/02/2046		1 776	1 324	0,00
Mansard Mortgages PLC				
3,185 % éch. 15/04/2047	£	2 209	2 506	0,01
4,772 % éch. 15/12/2049		3 599	4 086	0,01
5,522 % éch. 15/12/2049		3 199	3 726	0,01
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				
2,983 % éch. 25/03/2035	$	112	102	0,00
3,077 % éch. 25/03/2035		509	446	0,00
3,241 % éch. 25/02/2035		161	136	0,00
3,335 % éch. 25/03/2035		55	41	0,00
3,645 % éch. 25/09/2034		819	708	0,00
5,489 % éch. 25/09/2037		7 382	3 274	0,01
7,303 % éch. 25/12/2035		866	836	0,00
MASTR Alternative Loan Trust				
5,500 % éch. 25/04/2035		2 325	2 132	0,00
5,750 % éch. 25/08/2035 ^		1 350	712	0,00
6,500 % éch. 25/05/2034		66	62	0,00
MASTR Asset Securitization Trust				
5,000 % éch. 25/07/2019		0	0	0,00
6,000 % éch. 25/06/2036 ^		1 775	1 184	0,00
6,000 % éch. 25/10/2036		685	598	0,00
MASTR Reperforming Loan Trust				
4,749 % éch. 25/07/2035 ^		3 133	1 582	0,00
7,000 % éch. 25/08/2034		10	8	0,00
MASTR Seasoned Securitization Trust				
4,789 % éch. 25/10/2032		23	21	0,00
Merrill Lynch Alternative Note Asset Trust				
3,173 % éch. 25/06/2037 ^		2 574	1 504	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
0,000 % éch. 25/01/2029 (a)		672	3	0,00
3,380 % éch. 25/11/2035		85	78	0,00
3,455 % éch. 25/05/2036		4	3	0,00
3,948 % éch. 25/01/2037		36	34	0,00
3,994 % éch. 25/12/2035		2 090	1 967	0,00
4,286 % éch. 25/09/2029		125	118	0,00
4,324 % éch. 25/12/2034		140	135	0,00
4,841 % éch. 25/11/2029		784	684	0,00
4,849 % éch. 25/04/2029		465	423	0,00
5,049 % éch. 25/06/2028		1	1	0,00
5,109 % éch. 25/08/2035		3 354	3 078	0,01
5,334 % éch. 25/08/2036		3 942	3 064	0,01
Metlife Securitization Trust				
3,750 % éch. 25/03/2057	$	5 286	$ 4 988	0,01
Miravet SARL				
2,758 % éch. 26/05/2065	€	37 192	38 372	0,07
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust				
0,911 % éch. 15/02/2047 (a)	$	3 860	21	0,00
3,046 % éch. 15/04/2048		40 000	37 886	0,07
Morgan Stanley Capital Trust				
6,268 % éch. 15/07/2035		34 709	33 384	0,06
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
2,845 % éch. 25/11/2037 ^		94	63	0,00
2,980 % éch. 25/11/2037		6 659	4 362	0,01
3,665 % éch. 25/03/2036 ^		44	30	0,00
3,684 % éch. 25/05/2036 ^		1 793	1 055	0,00
3,835 % éch. 25/08/2034		37	35	0,00
4,386 % éch. 25/06/2036		1 206	1 151	0,00
4,709 % éch. 25/06/2036		3 663	856	0,00
4,729 % éch. 25/08/2036		6 027	1 836	0,00
5,500 % éch. 25/10/2037 ^		319	289	0,00
5,514 % éch. 25/09/2035		2 719	2 579	0,01
5,750 % éch. 25/02/2036 ^		498	440	0,00
6,000 % éch. 25/12/2035		2 600	1 080	0,00
6,000 % éch. 25/08/2036 ^		2 347	1 623	0,00
6,000 % éch. 25/08/2036		1 213	571	0,00
6,000 % éch. 25/10/2037 ^		2 296	1 351	0,00
6,000 % éch. 25/10/2037		7 806	4 147	0,01
6,114 % éch. 25/11/2035		1 855	1 746	0,00
6,354 % éch. 25/08/2036 ^		1 284	261	0,00
6,369 % éch. 25/09/2035		1 317	1 244	0,00
6,500 % éch. 25/02/2036 ^		100	50	0,00
Morgan Stanley Re-REMIC Trust				
3,372 % éch. 26/12/2036		2 520	2 147	0,00
Morgan Stanley Resecuritization Trust				
2,332 % éch. 26/06/2047		5 857	4 564	0,01
2,528 % éch. 26/11/2046		3 179	2 767	0,01
Mortgage Equity Conversion Asset Trust				
5,130 % éch. 25/02/2042		7 543	7 013	0,01
Mortgage Funding PLC				
4,611 % éch. 13/03/2046	£	9 030	10 675	0,02
MortgageIT Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
4,849 % éch. 25/06/2047	$	8 506	6 867	0,01
4,889 % éch. 25/09/2037		3 410	3 016	0,01
MortgageIT Trust				
4,949 % éch. 25/10/2035		98	91	0,00
4,989 % éch. 25/08/2035		1 835	1 715	0,00
5,009 % éch. 25/12/2035		1 778	1 676	0,00
5,274 % éch. 25/02/2035		385	367	0,00
5,370 % éch. 25/02/2035		2	2	0,00
New Century Alternative Mortgage Loan Trust				
4,640 % éch. 25/10/2036 ^		6 301	1 335	0,00
New Century Home Equity Loan Trust				
3,750 % éch. 25/08/2055		5 092	4 754	0,01
New Residential Mortgage Loan Trust				
4,500 % éch. 25/05/2058		17 797	16 723	0,03
Newgate Funding PLC				
1,811 % éch. 01/12/2050	€	4 982	4 839	0,01
2,204 % éch. 01/12/2050		1 456	1 371	0,00
2,646 % éch. 15/12/2050		10 578	10 528	0,02
3,379 % éch. 01/12/2050	£	3 686	4 184	0,01
3,839 % éch. 01/12/2050		27 913	31 374	0,06
3,956 % éch. 15/12/2050		9 769	10 990	0,02
4,796 % éch. 15/12/2050		2 824	3 164	0,01
5,046 % éch. 15/12/2050		450	484	0,00
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				
4,042 % éch. 25/06/2036	$	281	210	0,00
4,639 % éch. 25/06/2037		623	548	0,00
4,909 % éch. 25/12/2035		784	217	0,00
5,034 % éch. 25/05/2035		1 610	823	0,00
5,077 % éch. 25/02/2036 ^		35	30	0,00
5,389 % éch. 25/05/2035		1 320	1 052	0,00
5,409 % éch. 25/08/2034		369	351	0,00
5,688 % éch. 25/07/2035		595	576	0,00
6,408 % éch. 25/05/2036 ^		737	167	0,00
Nomura Resecuritization Trust				
1,790 % éch. 26/03/2037		2 511	2 083	0,00
5,289 % éch. 25/07/2036		20 338	19 412	0,03
NovaStar Mortgage Funding Trust				
0,412 % éch. 25/09/2046		11 754	4 114	0,01

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
OBX Trust				
5,039 % éch. 25/06/2057	$	2 022	$ 1 911	0,00
5,239 % éch. 25/04/2048		814	801	0,00
Paragon Mortgages PLC				
4,290 % éch. 15/05/2045	£	8 749	10 470	0,02
Pepper Residential Securities Trust				
5,239 % éch. 18/11/2060	$	3 660	3 651	0,01
PHH Alternative Mortgage Trust				
4,869 % éch. 25/05/2037		2 247	2 044	0,00
5,089 % éch. 25/07/2037		1 015	988	0,00
Polaris PLC				
4,222 % éch. 23/12/2058	£	4 675	5 487	0,01
4,682 % éch. 27/05/2057		14 989	17 972	0,03
6,082 % éch. 23/05/2059		2 768	3 232	0,01
Precise Mortgage Funding PLC				
0,000 % éch. 12/12/2055 (e)		0	13 787	0,02
4,186 % éch. 12/03/2055		8 030	9 636	0,02
4,265 % éch. 16/10/2056		11 520	13 670	0,02
4,785 % éch. 16/10/2056		1 200	1 404	0,00
5,035 % éch. 16/10/2056		1 000	1 157	0,00
5,285 % éch. 16/10/2056		1 000	1 141	0,00
6,435 % éch. 16/10/2056		1 000	1 144	0,00
Prime Mortgage Trust				
6,000 % éch. 25/06/2036 ^	$	12	12	0,00
Primrose Residential DAC				
2,644 % éch. 24/03/2061	€	4 077	4 250	0,01
2,894 % éch. 24/10/2061		32 423	33 731	0,06
Proteus RMBS DAC				
0,000 % éch. 29/10/2054 (b)(e)		13 990	14 654	0,03
0,000 % éch. 29/10/2054		200	432	0,00
2,055 % éch. 29/10/2054		58 627	62 540	0,11
2,505 % éch. 29/10/2054		8 681	9 260	0,02
2,705 % éch. 29/10/2054		6 313	6 734	0,01
3,355 % éch. 29/10/2054		4 735	5 049	0,01
4,605 % éch. 29/10/2054		3 946	4 206	0,01
RBSGC Mortgage Loan Trust				
4,839 % éch. 25/01/2037 ^	$	540	191	0,00
RBSGC Structured Trust				
5,500 % éch. 25/11/2035 ^		67	56	0,00
RBSSP Resecuritization Trust				
3,176 % éch. 26/01/2036		6 829	6 020	0,01
3,372 % éch. 26/12/2036		3 220	3 009	0,01
4,256 % éch. 27/06/2036		2 100	1 612	0,00
6,000 % éch. 26/05/2036		1 525	742	0,00
6,000 % éch. 26/08/2037		580	473	0,00
6,000 % éch. 26/10/2037		2 199	1 890	0,00
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
2,161 % éch. 25/12/2036 (a)		1 991	165	0,00
2,251 % éch. 25/01/2037 (a)		2 022	160	0,00
2,261 % éch. 25/12/2036 (a)		791	67	0,00
2,644 % éch. 25/10/2037		5 066	4 413	0,01
2,811 % éch. 25/12/2036 (a)		1 208	117	0,00
3,408 % éch. 25/09/2045		435	380	0,00
3,430 % éch. 25/02/2035 ^		485	394	0,00
3,483 % éch. 25/11/2037		450	366	0,00
3,548 % éch. 25/08/2035		1 708	1 398	0,00
3,552 % éch. 25/02/2035 ^		440	226	0,00
3,809 % éch. 25/08/2035 ^		123	106	0,00
3,839 % éch. 25/07/2035 ^		932	845	0,00
4,589 % éch. 25/05/2037		105	90	0,00
4,639 % éch. 25/03/2037 ^		2 150	1 561	0,00
4,689 % éch. 25/08/2035		155	117	0,00
4,689 % éch. 25/12/2036		3 710	2 597	0,01
4,689 % éch. 25/06/2037 ^		1 031	921	0,00
4,709 % éch. 25/01/2037		4 814	4 031	0,01
4,729 % éch. 25/12/2036		2 449	2 280	0,00
4,729 % éch. 25/01/2037		2 074	1 689	0,00
4,739 % éch. 25/12/2036		2 110	1 462	0,00
4,749 % éch. 25/07/2036		1 033	902	0,00
4,749 % éch. 25/07/2036 ^		5 798	2 464	0,01
4,749 % éch. 25/01/2037 ^		2 022	1 358	0,00
4,769 % éch. 25/07/2036		1 345	1 174	0,00
4,769 % éch. 25/09/2036 ^		1 849	1 689	0,00
4,769 % éch. 25/12/2036		1 475	1 253	0,00
4,769 % éch. 25/07/2037		4 334	3 907	0,01
4,769 % éch. 25/05/2047		970	844	0,00
4,789 % éch. 25/08/2036 ^		150	114	0,00
4,789 % éch. 25/05/2037 ^		3 077	2 251	0,00
4,819 % éch. 25/05/2046		3 120	2 610	0,01
4,929 % éch. 25/02/2046 ^		74	47	0,00
4,929 % éch. 25/05/2046 ^	$	2 730	$ 2 128	0,00
4,989 % éch. 25/04/2036		2 055	1 708	0,00
4,989 % éch. 25/03/2037 ^		4 754	3 577	0,01
5,500 % éch. 25/06/2035 ^		1 032	848	0,00
5,500 % éch. 25/09/2035 ^		1 441	1 159	0,00
5,500 % éch. 25/02/2036		614	483	0,00
5,750 % éch. 25/01/2037		1 625	1 193	0,00
5,751 % éch. 25/02/2036 ^		2 033	1 615	0,00
6,000 % éch. 25/09/2035 ^		2 288	1 978	0,00
6,000 % éch. 25/12/2035		1 046	881	0,00
6,000 % éch. 25/05/2036 ^		482	387	0,00
6,000 % éch. 25/06/2036 ^		2 822	2 243	0,00
6,000 % éch. 25/07/2036 ^		297	224	0,00
6,000 % éch. 25/08/2036 ^		5 266	4 135	0,01
6,000 % éch. 25/09/2036 ^		938	724	0,00
6,000 % éch. 25/11/2036 ^		190	153	0,00
6,000 % éch. 25/01/2037		462	345	0,00
6,000 % éch. 25/01/2037 ^		3 640	2 774	0,01
6,000 % éch. 25/03/2037 ^		435	359	0,00
6,000 % éch. 25/04/2037 ^		365	287	0,00
6,000 % éch. 25/05/2037 ^		315	252	0,00
6,000 % éch. 25/06/2037 ^		462	354	0,00
6,250 % éch. 25/01/2037 ^		123	98	0,00
6,250 % éch. 25/02/2037 ^		2 913	2 266	0,00
6,500 % éch. 25/09/2036 ^		487	232	0,00
6,500 % éch. 25/11/2036 ^		251	202	0,00
6,500 % éch. 25/02/2037		4 974	3 930	0,01
6,750 % éch. 25/06/2037		903	381	0,00
Residential Asset Securitization Trust				
4,939 % éch. 25/11/2035 ^		119	56	0,00
5,500 % éch. 25/08/2034		846	799	0,00
5,500 % éch. 25/09/2035		2 659	1 363	0,00
5,750 % éch. 25/02/2036		1 425	1 300	0,00
6,000 % éch. 25/07/2035 ^		1 392	899	0,00
6,000 % éch. 25/02/2036		17 208	7 647	0,01
6,000 % éch. 25/04/2036 ^		2 904	1 426	0,00
6,000 % éch. 25/06/2036		900	387	0,00
6,000 % éch. 25/09/2036 ^		7 180	2 400	0,01
6,000 % éch. 25/12/2036 ^		9 913	3 203	0,01
6,000 % éch. 25/04/2037 ^		1 087	628	0,00
6,000 % éch. 25/07/2037 ^		1 076	435	0,00
6,000 % éch. 25/08/2037		2 332	1 401	0,00
6,000 % éch. 25/01/2046		1 502	646	0,00
6,000 % éch. 25/01/2046 ^		870	376	0,00
6,250 % éch. 25/08/2036		1 253	850	0,00
6,250 % éch. 25/12/2036 ^		2 013	766	0,00
6,500 % éch. 25/07/2036		1 070	333	0,00
6,500 % éch. 25/04/2037 ^		9 827	2 658	0,01
6,500 % éch. 25/06/2037		6 827	1 721	0,00
6,609 % éch. 25/02/2037		11 721	3 351	0,01
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				
3,091 % éch. 25/06/2035		252	143	0,00
3,491 % éch. 25/08/2035 ^		42	21	0,00
3,658 % éch. 25/04/2037		147	85	0,00
3,726 % éch. 25/04/2037		90	70	0,00
3,726 % éch. 25/04/2037 ^		353	275	0,00
3,910 % éch. 25/09/2035 ^		1 900	1 186	0,00
4,117 % éch. 25/09/2036 ^		90	47	0,00
4,268 % éch. 25/11/2035 ^		83	38	0,00
4,500 % éch. 25/10/2018		13	6	0,00
4,545 % éch. 27/07/2037 ^		399	315	0,00
4,850 % éch. 25/08/2036 ^		1 216	855	0,00
6,000 % éch. 25/06/2036 ^		280	234	0,00
6,000 % éch. 25/07/2036 ^		209	170	0,00
6,000 % éch. 25/09/2036		801	612	0,00
6,250 % éch. 25/08/2036		1 314	1 099	0,00
Residential Mortgage Securities PLC				
4,681 % éch. 20/06/2070	£	11 982	14 361	0,03
5,331 % éch. 20/06/2070		1 355	1 608	0,00
RESIMAC Bastille Trust				
4,256 % éch. 05/09/2057	AUD	13 129	8 867	0,02
5,022 % éch. 05/12/2059	$	693	692	0,00
RESIMAC Premier				
4,308 % éch. 07/02/2052	AUD	10 719	7 257	0,01
5,267 % éch. 07/02/2052	$	2 547	2 540	0,01
Resloc UK PLC				
3,742 % éch. 15/12/2043	£	2 530	2 766	0,01
4,929 % éch. 15/12/2043	$	12 349	11 564	0,02
Ripon Mortgages PLC				
4,011 % éch. 28/08/2056	£	525 299	620 161	1,07
River Green Finance DAC				
2,202 % éch. 22/01/2032	€	13 323	13 746	0,02
RiverView HECM Trust				
4,659 % éch. 25/05/2047	$	5 216	$ 4 901	0,01
RMAC PLC				
4,206 % éch. 12/06/2046	£	18 133	21 703	0,04
RMAC Securities PLC				
2,140 % éch. 12/06/2044	€	1 954	1 912	0,00
2,230 % éch. 12/06/2044		6 215	6 075	0,01
2,260 % éch. 12/06/2044		1 857	1 812	0,00
2,460 % éch. 12/06/2044		6 258	6 013	0,01
3,656 % éch. 12/06/2044	£	1 745	1 962	0,00
3,676 % éch. 12/06/2044		22 576	24 897	0,04
3,936 % éch. 12/06/2044		796	871	0,00
4,336 % éch. 12/06/2044		1 539	1 636	0,00
4,885 % éch. 12/06/2044	$	313	297	0,00
Rochester Financing PLC				
4,126 % éch. 18/12/2044	£	2 529	2 933	0,01
Roundstone Securities DAC				
0,000 % éch. 28/09/2055	€	19 776	15 132	0,03
1,000 % éch. 28/09/2055		3 941	3 581	0,01
2,725 % éch. 28/09/2055		130 791	138 611	0,24
2,875 % éch. 28/09/2055		15 538	16 380	0,03
3,125 % éch. 28/09/2055		10 594	11 141	0,02
3,625 % éch. 28/09/2055		6 356	6 656	0,01
4,375 % éch. 28/09/2055		10 594	11 010	0,02
Sequoia Mortgage Trust				
3,139 % éch. 20/06/2037 ^	$	3 407	2 778	0,01
3,194 % éch. 20/07/2037		1 598	1 285	0,00
3,867 % éch. 20/02/2034		263	230	0,00
4,993 % éch. 20/11/2034		706	626	0,00
Sestante Finance SRL				
1,722 % éch. 23/07/2046	€	16 826	16 757	0,03
Shamrock Residential DAC				
2,744 % éch. 24/12/2059		27 437	28 828	0,05
2,744 % éch. 24/01/2061		22 644	23 611	0,04
3,144 % éch. 24/02/2071		45 531	47 461	0,08
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				
3,656 % éch. 20/01/2054	£	12 445	14 608	0,03
Stratton Hawksmoor PLC				
4,798 % éch. 25/02/2053		63 113	72 851	0,13
5,048 % éch. 25/02/2053		37 882	42 619	0,07
5,298 % éch. 25/02/2053		29 847	33 005	0,06
Stratton Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2060		108 629	129 559	0,22
4,287 % éch. 12/03/2052		13 621	16 319	0,03
4,292 % éch. 25/09/2051		31 582	37 504	0,07
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,513 % éch. 25/08/2036	$	3 299	2 342	0,01
3,550 % éch. 25/02/2036 ^		3 186	2 546	0,01
3,637 % éch. 25/10/2036		2 131	1 892	0,00
3,652 % éch. 25/07/2035 ^		184	114	0,00
3,688 % éch. 25/07/2035 ^		715	609	0,00
3,791 % éch. 25/11/2035		50	37	0,00
3,930 % éch. 25/05/2036		917	684	0,00
3,980 % éch. 25/09/2034		3	3	0,00
4,006 % éch. 25/04/2036		329	277	0,00
4,009 % éch. 25/01/2035		56	53	0,00
4,040 % éch. 25/01/2035		231	218	0,00
4,108 % éch. 25/11/2037 ^		201	146	0,00
4,115 % éch. 25/02/2035		2 718	2 534	0,01
4,222 % éch. 25/10/2035 ^		90	82	0,00
4,268 % éch. 25/11/2037 ^		335	285	0,00
4,527 % éch. 25/12/2034		8	8	0,00
4,689 % éch. 25/09/2034		321	277	0,00
4,809 % éch. 25/10/2035		2 105	1 842	0,00
4,829 % éch. 25/05/2037		826	719	0,00
4,869 % éch. 25/05/2037 ^		1 572	1 351	0,00
4,939 % éch. 25/09/2034		4 504	3 782	0,01
5,364 % éch. 25/08/2035		1 816	1 624	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
2,770 % éch. 19/10/2034		361	306	0,00
3,210 % éch. 27/12/2035 ^		141	140	0,00
3,278 % éch. 25/05/2047 ^		3 196	2 546	0,01
3,448 % éch. 25/12/2035 ^		1 339	1 055	0,00
4,509 % éch. 25/08/2036		8 937	7 515	0,01
4,509 % éch. 25/10/2036		4 151	3 593	0,01
4,559 % éch. 25/02/2036		2 135	1 637	0,00
4,569 % éch. 25/01/2037		2 205	1 898	0,00
4,569 % éch. 25/09/2047		204	182	0,00
4,609 % éch. 25/09/2047		10 028	8 119	0,02
4,709 % éch. 25/01/2037		3 400	2 947	0,01

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,749 % éch. 25/07/2046	$ 4 292	$ 3 518	0,01
4,789 % éch. 25/02/2036	319	249	0,00
4,809 % éch. 25/05/2036	2 517	1 903	0,00
4,809 % éch. 25/09/2047 ^	8 981	7 173	0,01
4,819 % éch. 19/04/2035	3	3	0,00
4,829 % éch. 25/05/2036	10 490	8 027	0,01
4,839 % éch. 19/07/2035	39	34	0,00
4,849 % éch. 25/05/2045	59	52	0,00
4,939 % éch. 19/07/2034	115	102	0,00
4,939 % éch. 25/09/2047 ^	5 756	4 574	0,01
4,949 % éch. 25/02/2036 ^	83	64	0,00
5,464 % éch. 19/12/2033	402	372	0,00
Structured Asset Securities Corp.			
4,639 % éch. 25/07/2035	1 912	1 764	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
4,639 % éch. 25/05/2036	2 080	1 705	0,00
SunTrust Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
3,191 % éch. 25/06/2037	1 320	1 204	0,00
3,691 % éch. 25/10/2037 ^	660	576	0,00
Taurus UK DAC			
2,637 % éch. 22/06/2029	£ 19 650	23 190	0,04
TBW Mortgage-Backed Trust			
5,500 % éch. 25/07/2036 ^	$ 10	1	0,00
5,965 % éch. 25/07/2037	3 760	1 212	0,00
6,450 % éch. 25/03/2037	13 600	3 290	0,01
TDA Mixto Fondo de Titulizacion de Activos			
2,261 % éch. 22/06/2040	€ 6 613	6 357	0,01
Temple Quay PLC			
0,000 % éch. 24/07/2085	£ 30 586	35 156	0,06
Terwin Mortgage Trust			
4,047 % éch. 25/10/2037	$ 5 398	2 070	0,00
Tharaldson Hotel Portfolio Trust			
5,618 % éch. 11/11/2034	27 138	25 811	0,05
5,868 % éch. 11/11/2034	13 609	12 858	0,02
6,518 % éch. 11/11/2034	25 064	23 601	0,04
Thornburg Mortgage Securities Trust			
1,528 % éch. 25/03/2044	748	725	0,00
2,517 % éch. 25/04/2036	1 024	919	0,00
2,994 % éch. 25/09/2037	531	512	0,00
3,010 % éch. 25/09/2037	1 214	1 168	0,00
3,433 % éch. 25/10/2046	52	49	0,00
3,653 % éch. 25/07/2036	1 416	1 170	0,00
6,666 % éch. 25/06/2037	112	100	0,00
Towd Point Mortgage Funding PLC			
3,596 % éch. 20/10/2051	£ 16 600	19 500	0,03
3,826 % éch. 20/07/2045	41 443	49 319	0,09
3,976 % éch. 20/10/2051	13 000	14 472	0,03
4,071 % éch. 20/10/2051	6 585	7 874	0,01
4,126 % éch. 20/10/2051	6 118	6 815	0,01
4,171 % éch. 20/05/2045	56 716	67 204	0,12
4,190 % éch. 20/02/2045	18 211	21 612	0,04
4,326 % éch. 20/10/2051	4 000	4 418	0,01
4,471 % éch. 20/02/2054	38 641	46 305	0,08
4,976 % éch. 20/10/2051	13 500	14 814	0,03
5,426 % éch. 20/10/2051	4 500	4 906	0,01
Towd Point Mortgage Trust			
2,750 % éch. 25/06/2057	$ 6 908	6 583	0,01
2,750 % éch. 25/10/2057	11 485	11 001	0,02
Tower Bridge Funding PLC			
4,151 % éch. 20/12/2063	£ 4 149	4 867	0,01
4,801 % éch. 20/09/2063	16 950	20 370	0,04
Trinidad Mortgage Securities PLC			
3,900 % éch. 24/01/2059	3 500	4 186	0,01
Trinity Square PLC			
4,279 % éch. 15/07/2059	34 300	40 493	0,07
4,579 % éch. 15/07/2059	12 400	14 489	0,03
4,879 % éch. 15/07/2059	8 600	9 915	0,02
5,629 % éch. 15/07/2059	5 700	6 569	0,01
Tudor Rose Mortgages			
4,031 % éch. 20/06/2048	8 274	9 814	0,02
Twin Bridges PLC			
4,386 % éch. 12/09/2050	13 348	16 023	0,03
4,637 % éch. 12/12/2054	24 436	29 273	0,05
5,387 % éch. 12/06/2055	5 819	6 871	0,01
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust			
0,775 % éch. 10/03/2046 (a)	$ 13 648	0	0,00
1,035 % éch. 10/04/2046 (a)	4 646	0	0,00
Uropa Securities PLC			
1,488 % éch. 10/10/2040	€ 6 612	6 706	0,01
3,266 % éch. 10/10/2040	£ 7 435	8 120	0,02
Verus Securitization Trust			
1,977 % éch. 25/03/2060	$ 687	$ 659	0,00
3,035 % éch. 25/03/2060	700	646	0,00
3,889 % éch. 25/03/2060	1 000	908	0,00
Wachovia Mortgage Loan Trust LLC			
3,539 % éch. 20/08/2035 ^	251	236	0,00
4,160 % éch. 20/10/2035 ^	226	214	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
2,499 % éch. 25/12/2046	1 971	1 724	0,00
2,509 % éch. 25/12/2046 ^	5 512	4 652	0,01
2,737 % éch. 25/05/2046	44	36	0,00
2,748 % éch. 25/02/2047 ^	2 525	2 103	0,00
2,748 % éch. 25/03/2047 ^	536	452	0,00
2,798 % éch. 25/06/2047	12 198	9 448	0,02
2,808 % éch. 25/04/2047	226	196	0,00
2,818 % éch. 25/04/2047 ^	1 828	1 524	0,00
2,818 % éch. 25/05/2047	4 633	3 674	0,01
2,826 % éch. 25/01/2037 ^	887	729	0,00
2,839 % éch. 25/02/2037 ^	1 522	1 304	0,00
2,846 % éch. 25/07/2047 ^	1 589	1 341	0,00
2,858 % éch. 25/07/2047	12 728	10 199	0,02
2,868 % éch. 25/03/2035	2 110	2 037	0,00
2,928 % éch. 25/10/2046 ^	6 408	5 357	0,01
2,945 % éch. 25/03/2037 ^	1 011	790	0,00
2,968 % éch. 25/09/2046 ^	3 238	2 814	0,01
2,987 % éch. 25/04/2035	1 635	1 500	0,00
3,038 % éch. 25/06/2046	152	136	0,00
3,048 % éch. 25/02/2046	2 551	2 245	0,00
3,093 % éch. 25/02/2037 ^	4 069	3 634	0,01
3,096 % éch. 25/08/2046	2 328	1 777	0,00
3,143 % éch. 25/05/2037 ^	1 275	1 052	0,00
3,197 % éch. 25/05/2037	1 451	1 211	0,00
3,217 % éch. 25/01/2037 ^	2 803	2 428	0,01
3,227 % éch. 25/06/2037 ^	1 552	1 348	0,00
3,229 % éch. 25/06/2037 ^	972	873	0,00
3,240 % éch. 25/06/2037 ^	1 340	1 170	0,00
3,266 % éch. 25/02/2037 ^	1 746	1 546	0,00
3,290 % éch. 25/02/2037 ^	8 811	7 956	0,01
3,293 % éch. 25/03/2037	120	108	0,00
3,298 % éch. 25/01/2047	4 982	4 446	0,01
3,329 % éch. 25/11/2036 ^	3 288	2 780	0,01
3,406 % éch. 25/12/2036 ^	683	641	0,00
3,495 % éch. 25/07/2034	258	175	0,00
3,508 % éch. 25/09/2036 ^	125	105	0,00
3,510 % éch. 25/12/2036 ^	6 413	5 557	0,01
3,524 % éch. 25/07/2037 ^	4 696	4 264	0,01
3,548 % éch. 25/09/2046	2 448	2 243	0,00
3,548 % éch. 25/10/2046	2 010	1 784	0,00
3,548 % éch. 25/11/2046	1 838	1 587	0,00
3,560 % éch. 25/08/2036 ^	869	729	0,00
3,565 % éch. 25/09/2036	4 081	3 485	0,01
3,600 % éch. 25/12/2036 ^	223	191	0,00
3,600 % éch. 25/12/2036	543	464	0,00
3,682 % éch. 25/08/2046 ^	948	834	0,00
3,784 % éch. 25/08/2046 ^	190	166	0,00
3,801 % éch. 25/10/2036 ^	2 802	2 506	0,01
3,801 % éch. 25/10/2036	1 491	1 334	0,00
3,864 % éch. 25/07/2037 ^	3 823	3 511	0,01
3,889 % éch. 25/12/2035	6 201	5 761	0,01
3,952 % éch. 25/01/2035	1 963	1 779	0,00
5,009 % éch. 25/01/2045	722	693	0,00
5,089 % éch. 25/12/2045	1 616	1 414	0,00
5,109 % éch. 25/10/2045	230	211	0,00
5,129 % éch. 25/01/2045	2 088	2 008	0,00
5,189 % éch. 25/06/2044	125	112	0,00
5,289 % éch. 25/10/2045	13 710	11 392	0,02
5,369 % éch. 25/10/2045	712	655	0,00
5,389 % éch. 25/12/2045	6 453	5 910	0,01
5,409 % éch. 25/08/2045	4 401	4 139	0,01
Warwick Finance Residential Mortgages PLC			
0,000 % éch. 21/12/2049 (e)	£ 2	10 014	0,02
4,387 % éch. 21/12/2049	66 613	80 128	0,14
4,456 % éch. 21/03/2042	2 857	3 360	0,01
5,087 % éch. 21/12/2049	12 810	15 409	0,03
5,587 % éch. 21/12/2049	6 405	7 704	0,01
6,087 % éch. 21/12/2049	3 660	4 402	0,01
6,587 % éch. 21/12/2049	3 660	4 402	0,01
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
2,808 % éch. 25/04/2047 ^	$ 4 576	3 709	0,01
2,878 % éch. 25/11/2046	103	82	0,00
2,968 % éch. 25/09/2046 ^	3 919	3 065	0,01
2,988 % éch. 25/04/2046	$ 4 204	$ 3 461	0,01
2,988 % éch. 25/07/2046 ^	6 121	3 766	0,01
3,008 % éch. 25/08/2046	3 804	2 350	0,01
3,298 % éch. 25/04/2047	18 794	15 498	0,03
4,051 % éch. 25/09/2036 ^	611	195	0,00
4,174 % éch. 25/10/2036 ^	9 797	3 666	0,01
4,283 % éch. 25/10/2036 ^	3 986	1 148	0,00
4,466 % éch. 25/05/2035 ^	3 355	2 860	0,01
4,709 % éch. 25/02/2037 ^	739	607	0,00
4,739 % éch. 25/02/2036 ^	1 423	1 239	0,00
4,909 % éch. 25/12/2035	2 888	2 462	0,01
5,500 % éch. 25/07/2035 ^	1 074	954	0,00
5,500 % éch. 25/11/2035 ^	90	80	0,00
5,750 % éch. 25/01/2036 ^	2 141	1 744	0,00
5,750 % éch. 25/02/2036 ^	133	119	0,00
6,000 % éch. 25/11/2035 ^	2 526	2 348	0,01
6,000 % éch. 25/07/2036	4 524	3 302	0,01
6,000 % éch. 25/04/2037	2 440	2 096	0,00
6,500 % éch. 25/11/2035 ^	3 484	1 863	0,00
6,500 % éch. 25/03/2036 ^	3 212	2 202	0,00
6,500 % éch. 25/05/2036 ^	3 151	2 729	0,01
6,812 % éch. 25/07/2036 ^	10 964	2 793	0,01
6,949 % éch. 25/07/2036 ^	1 993	508	0,00
7,000 % éch. 25/02/2036	2 724	2 037	0,00
Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
3,172 % éch. 25/01/2035	216	194	0,00
Wells Fargo Alternative Loan Trust			
1,681 % éch. 25/06/2037 (a)	864	40	0,00
4,739 % éch. 25/06/2037 ^	1 228	872	0,00
4,819 % éch. 25/06/2037	864	700	0,00
6,250 % éch. 25/07/2037 ^	3 094	2 591	0,01
6,250 % éch. 25/11/2037 ^	1 350	1 140	0,00
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust			
2,563 % éch. 25/04/2037	569	477	0,00
2,823 % éch. 25/03/2036	1 202	1 083	0,00
2,879 % éch. 25/04/2036	1 925	1 797	0,00
4,046 % éch. 25/08/2036 ^	1 103	1 012	0,00
4,076 % éch. 25/08/2035	854	808	0,00
4,414 % éch. 25/10/2037 ^	88	73	0,00
4,414 % éch. 25/11/2037 ^	273	233	0,00
4,437 % éch. 25/09/2036 ^	1 125	1 063	0,00
4,480 % éch. 25/10/2036 ^	105	93	0,00
4,488 % éch. 25/10/2036	2 480	2 263	0,00
4,564 % éch. 25/12/2036 ^	794	756	0,00
5,500 % éch. 25/12/2021	1	1	0,00
6,000 % éch. 25/06/2037 ^	851	714	0,00
Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust			
0,451 % éch. 15/03/2047 (a)	83 200	414	0,00
0,597 % éch. 15/03/2047 (a)	65 193	363	0,00
0,937 % éch. 15/03/2045 (a)	8 746	0	0,00
Worldwide Plaza Trust			
3,596 % éch. 10/11/2036	62 600	43 325	0,08
		7 380 526	12,73

TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Aames Mortgage Investment Trust			
5,169 % éch. 25/10/2035	10 940	10 712	0,02
AccessLex Institute			
4,934 % éch. 26/09/2033	5 212	5 023	0,01
Accredited Mortgage Loan Trust			
0,924 % éch. 25/04/2036	462	460	0,00
4,609 % éch. 25/02/2037	1 000	947	0,00
4,649 % éch. 25/09/2036	5 860	5 751	0,01
4,659 % éch. 25/09/2036	12 235	11 135	0,02
4,659 % éch. 25/02/2037	9 754	8 409	0,02
4,849 % éch. 25/12/2035 ^	13 735	9 668	0,02
5,259 % éch. 25/09/2035	5 921	5 544	0,01
5,409 % éch. 25/07/2035	2 496	2 302	0,00
5,469 % éch. 25/10/2034	1 678	1 560	0,00
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
4,509 % éch. 25/08/2036 ^	8 663	2 311	0,00
4,509 % éch. 25/12/2036	11 037	6 043	0,01
4,519 % éch. 25/12/2036	26 388	15 113	0,03
4,544 % éch. 25/08/2036	5 646	5 346	0,01
4,559 % éch. 25/11/2036	12 420	5 466	0,01
4,629 % éch. 25/01/2037	1 226	718	0,00
4,669 % éch. 25/07/2036	4 397	4 158	0,01
4,689 % éch. 25/07/2036	31 716	11 909	0,02
4,729 % éch. 25/01/2037	4 018	2 353	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,829 % éch. 25/12/2036	$	201	$	73	0,00
4,829 % éch. 25/01/2037		10 693		2 690	0,01
4,869 % éch. 25/04/2036		6 471		5 836	0,01
4,869 % éch. 25/07/2036		7 286		2 235	0,00
4,889 % éch. 25/01/2037		1 226		718	0,00
4,949 % éch. 25/06/2037		1 943		1 751	0,00
4,989 % éch. 25/02/2036		767		752	0,00
5,004 % éch. 25/12/2035		4 200		3 713	0,01
5,049 % éch. 25/11/2035		2 128		2 127	0,00
5,079 % éch. 25/05/2035		362		361	0,00
5,289 % éch. 25/12/2034		3 367		3 017	0,01
5,289 % éch. 25/08/2035		3 546		3 392	0,01
5,364 % éch. 25/11/2033		754		717	0,00
5,409 % éch. 25/04/2035		1 404		1 343	0,00
6,189 % éch. 25/06/2034		62		65	0,00
Aegis Asset-Backed Securities Trust					
4,559 % éch. 25/01/2037		1 245		948	0,00
5,034 % éch. 25/12/2035		2 170		2 035	0,00
5,109 % éch. 25/06/2035		2 757		2 544	0,01
5,109 % éch. 25/08/2035		922		884	0,00
Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates					
6,114 % éch. 25/10/2034		1 719		1 686	0,00
ALESCO Preferred Funding Ltd.					
5,009 % éch. 23/12/2037		28 840		26 590	0,05
5,049 % éch. 23/09/2037		7 010		6 467	0,01
5,089 % éch. 23/06/2036		17 016		16 468	0,03
5,109 % éch. 23/12/2035		8 102		7 612	0,01
5,129 % éch. 23/09/2037		2 000		1 728	0,00
5,179 % éch. 23/12/2036		5 000		4 294	0,01
5,479 % éch. 23/09/2038		6 781		6 436	0,01
Ameriquest Mortgage Securities Trust					
4,489 % éch. 25/10/2036		21 948		7 315	0,01
4,564 % éch. 25/10/2036		12 404		7 222	0,01
4,899 % éch. 25/04/2036		961		952	0,00
4,944 % éch. 25/04/2036		6 319		5 948	0,01
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					
2,834 % éch. 25/06/2033 ^		1 024		919	0,00
2,834 % éch. 25/06/2033		477		434	0,00
4,130 % éch. 25/06/2034		1 880		1 711	0,00
4,292 % éch. 25/07/2034		552		548	0,00
4,713 % éch. 25/12/2033		302		287	0,00
5,064 % éch. 25/01/2036		10 248		9 992	0,02
5,094 % éch. 25/01/2036		1 951		1 940	0,00
5,139 % éch. 25/01/2036		4 850		4 710	0,01
5,154 % éch. 25/10/2035		644		639	0,00
5,184 % éch. 25/03/2035		444		444	0,00
5,259 % éch. 25/11/2035		6 710		6 251	0,01
5,319 % éch. 25/05/2035		2 371		2 316	0,00
5,349 % éch. 25/10/2035		6 196		5 570	0,01
5,364 % éch. 25/07/2035		12 628		11 650	0,02
5,364 % éch. 25/09/2035		5 750		4 461	0,01
5,409 % éch. 25/09/2034		442		431	0,00
5,409 % éch. 25/01/2035 ^		2 011		1 823	0,00
5,439 % éch. 25/05/2035		1 961		1 755	0,00
5,484 % éch. 25/09/2034		4 759		4 285	0,01
5,949 % éch. 25/01/2035		1 591		1 270	0,00
6,039 % éch. 25/11/2034		1 399		1 254	0,00
6,114 % éch. 25/08/2035		2 000		1 796	0,00
6,264 % éch. 25/07/2034		1 546		1 478	0,00
Ares European CLO DAC					
1,988 % éch. 15/04/2030	€	1 977		2 053	0,00
2,328 % éch. 15/01/2036		4 200		4 282	0,01
2,582 % éch. 21/10/2033		28 450		29 751	0,05
Argent Mortgage Loan Trust					
4,869 % éch. 25/05/2035	$	8 693		7 784	0,01
Argent Securities Trust					
4,499 % éch. 25/09/2036		13 909		4 646	0,01
4,609 % éch. 25/05/2036		4 075		1 031	0,00
4,629 % éch. 25/09/2036		10 900		3 641	0,01
4,689 % éch. 25/06/2036		16 044		10 656	0,02
4,689 % éch. 25/07/2036		30 118		26 050	0,05
4,709 % éch. 25/05/2036		11 683		2 956	0,01
4,739 % éch. 25/04/2036		1 607		944	0,00
4,769 % éch. 25/03/2036		14 278		10 551	0,02
4,929 % éch. 25/05/2036		691		175	0,00
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					
4,859 % éch. 25/01/2036		8 743		8 438	0,02
5,049 % éch. 25/11/2035		10 413		9 994	0,02
5,149 % éch. 25/02/2036	$	13 099	$	9 996	0,02
5,154 % éch. 25/10/2035		5 750		5 096	0,01
5,289 % éch. 25/05/2034		313		257	0,00
5,514 % éch. 25/11/2034		2 900		2 833	0,01
Asset-Backed Funding Certificates Trust					
4,519 % éch. 25/01/2037		507		352	0,00
4,529 % éch. 25/10/2036		209		190	0,00
4,549 % éch. 25/01/2037		11 529		6 848	0,01
4,609 % éch. 25/10/2036		9 718		8 031	0,01
4,669 % éch. 25/11/2036		9 918		5 911	0,01
4,809 % éch. 25/09/2036 ^		6 335		5 760	0,01
5,049 % éch. 25/03/2035		3 962		3 794	0,01
5,089 % éch. 25/06/2034		3 048		2 862	0,01
5,169 % éch. 25/11/2033		1 086		998	0,00
5,289 % éch. 25/02/2034		216		210	0,00
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust					
3,018 % éch. 25/03/2036		2 345		1 876	0,00
3,199 % éch. 25/03/2036		1 062		898	0,00
3,444 % éch. 25/12/2036		2 362		2 235	0,00
3,658 % éch. 25/12/2036		3 835		3 412	0,01
4,734 % éch. 25/11/2036		5 472		5 093	0,01
5,289 % éch. 25/11/2035		3 597		3 282	0,01
5,364 % éch. 25/11/2033		904		879	0,00
5,364 % éch. 25/05/2035		550		549	0,00
5,364 % éch. 25/06/2035 ^		2 510		2 125	0,00
5,409 % éch. 25/07/2035		3 500		3 316	0,01
6,234 % éch. 25/05/2035		307		282	0,00
Atlas Senior Loan Fund Ltd.					
5,113 % éch. 20/04/2028		4 065		4 038	0,01
Aurium CLO DAC					
2,048 % éch. 16/04/2030	€	29 884		31 267	0,05
Auto Abs Spanish Loans					
3,710 % éch. 28/02/2032		7 500		7 827	0,01
4,410 % éch. 28/02/2032		12 100		12 405	0,02
Bain Capital Euro CLO					
2,278 % éch. 15/04/2032		10 000		10 371	0,02
Bastille Euro CLO DAC					
2,528 % éch. 15/01/2034		20 000		20 602	0,04
Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust					
4,914 % éch. 28/04/2036	$	1 237		1 200	0,00
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust					
3,644 % éch. 25/07/2036		78		77	0,00
4,081 % éch. 25/10/2036		131		127	0,00
4,421 % éch. 25/11/2035 ^		2 012		1 806	0,00
4,529 % éch. 25/11/2036		599		579	0,00
4,549 % éch. 25/01/2037		8 432		8 356	0,02
4,619 % éch. 25/02/2037		1 500		1 372	0,00
4,639 % éch. 25/04/2037 ^		1 837		2 509	0,01
4,689 % éch. 25/06/2047		192		183	0,00
4,729 % éch. 25/05/2035		14		14	0,00
4,729 % éch. 25/12/2036		9 843		9 241	0,02
4,739 % éch. 25/06/2047		9 140		7 396	0,01
4,839 % éch. 25/01/2047		2 227		2 135	0,00
4,889 % éch. 25/09/2034		1 578		1 540	0,00
4,889 % éch. 25/08/2036		5 489		4 971	0,01
4,889 % éch. 25/05/2037		2 389		2 329	0,00
4,909 % éch. 25/09/2036 ^		2 206		1 876	0,00
4,915 % éch. 25/12/2035		2 333		1 958	0,00
4,929 % éch. 25/04/2036		2 087		2 075	0,00
4,929 % éch. 25/06/2036		9		9	0,00
4,974 % éch. 25/11/2034		438		427	0,00
5,019 % éch. 25/12/2035		484		483	0,00
5,032 % éch. 25/08/2034		492		467	0,00
5,094 % éch. 25/01/2035		2 578		2 487	0,00
5,124 % éch. 25/09/2035		162		161	0,00
5,389 % éch. 25/10/2037		169		169	0,00
5,394 % éch. 25/06/2035		3 252		3 105	0,01
5,397 % éch. 25/02/2034		249		243	0,00
5,439 % éch. 25/08/2037		10 932		9 784	0,02
5,514 % éch. 25/02/2035		774		769	0,00
5,589 % éch. 25/06/2036		1 223		1 173	0,00
6,339 % éch. 25/11/2039		1 051		1 040	0,00
6,500 % éch. 25/10/2036 ^		2 244		1 218	0,00
7,539 % éch. 25/12/2042		1 707		1 787	0,00
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust					
6,389 % éch. 25/03/2037		2 151		1 951	0,00
Black Diamond CLO DAC					
2,834 % éch. 03/10/2029	€	557		592	0,00
4,793 % éch. 03/10/2029	$	581		579	0,00
Blackrock European CLO DAC					
2,228 % éch. 15/07/2030	€	9 335		9 774	0,02
BNC Mortgage Loan Trust					
3,797 % éch. 25/10/2036	$	5 752	$	4 237	0,01
4,549 % éch. 25/03/2037		11 177		10 310	0,02
4,639 % éch. 25/07/2037		11 631		9 693	0,02
4,699 % éch. 25/05/2037		6 189		5 596	0,01
4,709 % éch. 25/11/2036		1 289		1 245	0,00
BNPP AM Euro CLO DAC					
2,028 % éch. 15/10/2031	€	11 690		12 229	0,02
Bombardier Capital Mortgage Securitization Corp. Trust					
7,180 % éch. 15/12/2029	$	980		144	0,00
7,440 % éch. 15/12/2029		10 140		1 543	0,00
7,575 % éch. 15/06/2030		936		136	0,00
Cairn CLO DAC					
2,275 % éch. 31/01/2030	€	26 296		27 513	0,05
Camber PLC					
1,571 % éch. 09/11/2053	$	30 714		271	0,00
Capitalsource Real Estate Loan Trust					
4,559 % éch. 20/01/2037		12 450		11 619	0,02
4,659 % éch. 20/01/2037		5 400		4 695	0,01
4,759 % éch. 20/01/2037		3 000		2 171	0,00
Carrington Mortgage Loan Trust					
4,539 % éch. 25/04/2036 ^		2 497		2 410	0,00
4,539 % éch. 25/08/2036		9 482		8 911	0,02
4,549 % éch. 25/10/2036		13 065		12 534	0,02
4,649 % éch. 25/02/2037		15 332		13 776	0,02
4,989 % éch. 25/01/2036		1 055		1 002	0,00
5,139 % éch. 25/10/2035		7 814		7 433	0,01
5,184 % éch. 25/09/2035		2 846		2 698	0,01
5,364 % éch. 25/05/2035		125		125	0,00
5,379 % éch. 25/06/2035		6 280		6 055	0,01
5,439 % éch. 25/05/2035		3 800		3 623	0,01
Centex Home Equity Loan Trust					
4,839 % éch. 25/06/2036		665		663	0,00
4,869 % éch. 25/06/2036		1 300		1 248	0,00
5,109 % éch. 25/01/2035		1 656		1 635	0,00
5,139 % éch. 25/01/2035		2 320		2 236	0,00
5,319 % éch. 25/09/2034		215		205	0,00
5,349 % éch. 25/03/2035		3 157		2 956	0,01
6,060 % éch. 25/09/2034		666		640	0,00
Chase Funding Trust					
5,139 % éch. 25/09/2033		17		17	0,00
CIT Mortgage Loan Trust					
5,739 % éch. 25/10/2037		4 795		4 773	0,01
5,889 % éch. 25/10/2037		71 896		68 463	0,12
Citigroup Mortgage Loan Trust					
4,249 % éch. 25/10/2037		435		402	0,00
4,459 % éch. 25/05/2037		2 012		1 383	0,00
4,529 % éch. 25/01/2037		10 799		9 714	0,02
4,539 % éch. 25/12/2036		963		403	0,00
4,549 % éch. 25/12/2036		18 420		10 385	0,02
4,564 % éch. 25/05/2037		389		380	0,00
4,569 % éch. 25/01/2037		14 470		10 788	0,02
4,589 % éch. 25/05/2037		4 377		3 024	0,01
4,649 % éch. 25/07/2045		4 380		3 152	0,01
4,659 % éch. 25/05/2037		25 963		23 918	0,04
4,669 % éch. 25/12/2036		4 135		3 905	0,01
4,679 % éch. 25/09/2036		6 594		6 276	0,01
4,709 % éch. 25/09/2036		1 456		1 047	0,00
4,789 % éch. 25/11/2046		5 029		4 853	0,01
4,809 % éch. 25/12/2036		4 008		3 923	0,01
4,809 % éch. 25/01/2037		2 496		2 433	0,00
4,839 % éch. 25/01/2037		434		393	0,00
4,869 % éch. 25/08/2036		1 500		1 310	0,00
4,889 % éch. 25/08/2036		526		509	0,00
4,909 % éch. 25/03/2036		4 021		3 577	0,01
4,989 % éch. 25/12/2035 ^		1 827		1 740	0,00
5,064 % éch. 25/11/2045		58		58	0,00
5,775 % éch. 25/10/2036		1 027		673	0,00
6,352 % éch. 25/05/2036 ^		386		143	0,00
7,250 % éch. 25/05/2036		12 301		6 434	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates					
5,394 % éch. 25/10/2034		4 499		4 057	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.					
4,649 % éch. 25/03/2037		5 856		4 976	0,01
4,739 % éch. 25/03/2037		2 045		1 691	0,00
4,794 % éch. 25/08/2036		75		75	0,00
4,824 % éch. 25/11/2036		4 562		4 474	0,01
4,839 % éch. 25/10/2036		4 309		4 263	0,01
4,854 % éch. 25/08/2036		2 080		1 863	0,00

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,884 % éch. 25/10/2036	$ 400	$ 381	0,00
5,019 % éch. 25/02/2035	2 006	1 853	0,00
5,064 % éch. 25/10/2035 ^	2 245	2 179	0,00
5,124 % éch. 25/09/2035 ^	2 625	2 590	0,01
5,169 % éch. 25/01/2036	1 078	1 065	0,00
6,069 % éch. 25/07/2035	4 266	3 672	0,01
Commonbond Student Loan Trust			
2,550 % éch. 25/05/2041	2 241	2 085	0,00
5,239 % éch. 25/05/2041	147	145	0,00
Conseco Finance Corp.			
6,280 % éch. 01/09/2030	673	673	0,00
6,560 % éch. 01/11/2028	1 410	1 403	0,00
6,920 % éch. 01/12/2030	3 068	3 074	0,01
7,060 % éch. 01/02/2031	1 592	1 419	0,00
7,500 % éch. 01/03/2030	13 119	5 456	0,01
7,850 % éch. 15/11/2026	88	88	0,00
7,860 % éch. 01/03/2030	4 845	2 094	0,00
Conseco Finance Securitizations Corp.			
5,870 % éch. 01/09/2033	1 937	1 904	0,00
7,100 % éch. 01/02/2033	80	77	0,00
7,770 % éch. 01/09/2031	920	905	0,00
7,970 % éch. 01/05/2032	1 887	404	0,00
8,060 % éch. 01/09/2029	14 402	3 300	0,01
8,260 % éch. 01/12/2030	13 372	3 769	0,01
8,310 % éch. 01/05/2032	20 172	4 495	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates			
4,669 % éch. 25/03/2037	2 263	2 190	0,00
4,869 % éch. 25/04/2037	802	656	0,00
4,884 % éch. 25/03/2037 ^	7 272	6 151	0,01
4,889 % éch. 25/01/2046 ^	12 601	11 785	0,02
5,139 % éch. 25/05/2034	288	283	0,00
5,289 % éch. 25/03/2047 ^	1 527	1 256	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
3,209 % éch. 25/04/2036	3 029	2 818	0,01
3,363 % éch. 25/03/2035	3 700	3 185	0,01
3,363 % éch. 25/04/2035	1 419	1 383	0,00
3,542 % éch. 25/02/2036	237	237	0,00
3,694 % éch. 25/12/2034	1 099	1 068	0,00
3,856 % éch. 25/01/2037	7 503	7 285	0,01
3,996 % éch. 25/01/2037	13 000	11 815	0,02
4,083 % éch. 25/05/2036	25 519	24 599	0,04
4,332 % éch. 25/10/2046 ^	9 408	9 171	0,02
4,381 % éch. 25/11/2034	9 148	8 789	0,02
4,486 % éch. 25/07/2036	4 902	4 345	0,01
4,529 % éch. 25/06/2035	13 684	12 364	0,02
4,529 % éch. 25/05/2037	6 275	5 753	0,01
4,529 % éch. 25/06/2037	13 044	11 950	0,02
4,529 % éch. 25/07/2037	3 213	2 901	0,01
4,529 % éch. 25/07/2037 ^	867	849	0,00
4,529 % éch. 25/08/2037	179	175	0,00
4,529 % éch. 25/08/2037 ^	1 668	1 443	0,00
4,529 % éch. 25/04/2047	2 324	2 219	0,00
4,529 % éch. 25/06/2047 ^	1 317	1 167	0,00
4,529 % éch. 25/06/2047	1 219	1 117	0,00
4,539 % éch. 25/04/2047 ^	994	992	0,00
4,539 % éch. 25/06/2047 ^	152	152	0,00
4,559 % éch. 25/06/2047	17 484	16 620	0,03
4,569 % éch. 25/06/2047	507	471	0,00
4,569 % éch. 25/11/2047 ^	2 362	2 595	0,01
4,579 % éch. 25/11/2037	9 087	8 302	0,02
4,589 % éch. 25/06/2047 ^	10 147	8 685	0,02
4,599 % éch. 25/05/2047 ^	6 679	5 910	0,01
4,609 % éch. 25/05/2037	6 812	6 447	0,01
4,609 % éch. 25/08/2037	17 550	14 866	0,03
4,609 % éch. 25/09/2037 ^	6 797	6 977	0,01
4,609 % éch. 25/06/2047	12 490	11 909	0,02
4,609 % éch. 25/06/2047 ^	11 245	9 777	0,02
4,619 % éch. 25/05/2037	13 396	12 596	0,02
4,619 % éch. 25/07/2037 ^	18 023	14 972	0,03
4,619 % éch. 25/10/2047	6 110	6 006	0,01
4,639 % éch. 25/06/2047	12 932	12 389	0,02
4,649 % éch. 25/12/2036 ^	8 103	7 430	0,01
4,649 % éch. 25/09/2046	16 343	15 489	0,03
4,649 % éch. 25/06/2047	6 682	5 195	0,01
4,649 % éch. 25/06/2047 ^	5 519	4 315	0,01
4,669 % éch. 25/02/2037	540	508	0,00
4,824 % éch. 25/01/2045 ^	2 700	2 395	0,00
4,869 % éch. 25/02/2037	10 186	9 768	0,02
4,869 % éch. 25/03/2037	15 317	14 291	0,03
4,869 % éch. 25/03/2047 ^	8 899	7 822	0,01
4,889 % éch. 25/04/2046 ^	5 662	5 388	0,01
4,909 % éch. 25/09/2046 ^	2 667	2 555	0,01
4,914 % éch. 25/08/2036	$ 4 064	$ 3 871	0,01
4,944 % éch. 25/07/2036	2 908	2 592	0,01
4,974 % éch. 25/06/2036 ^	3 260	3 058	0,01
4,989 % éch. 25/06/2036	1 238	1 226	0,00
5,079 % éch. 25/04/2036	17 497	16 914	0,03
5,089 % éch. 25/03/2036 ^	6 205	5 610	0,01
5,094 % éch. 25/09/2035	1 674	1 554	0,00
5,109 % éch. 25/08/2035	1 794	1 609	0,00
5,115 % éch. 25/10/2035	1 250	1 052	0,00
5,229 % éch. 25/10/2047	1 188	1 146	0,00
5,289 % éch. 25/02/2036 ^	4 162	3 856	0,01
5,289 % éch. 25/05/2036	248	241	0,00
5,348 % éch. 25/02/2036	7 000	5 809	0,01
5,364 % éch. 25/12/2035	1 015	1 000	0,00
5,364 % éch. 25/01/2036	6 518	6 290	0,01
5,379 % éch. 25/02/2036 ^	4 000	3 523	0,01
5,394 % éch. 25/10/2035	4 908	4 824	0,01
5,439 % éch. 25/11/2035	394	393	0,00
5,454 % éch. 25/07/2035	3 952	3 894	0,01
5,454 % éch. 25/08/2035	2 048	2 037	0,00
5,454 % éch. 25/10/2035	7 500	7 033	0,01
5,469 % éch. 25/05/2036	13 260	10 326	0,02
5,484 % éch. 25/07/2035	172	170	0,00
5,484 % éch. 25/04/2036 ^	3 700	3 464	0,01
5,529 % éch. 25/01/2036	3 000	2 836	0,01
5,589 % éch. 25/11/2035 ^	7 978	7 178	0,01
5,633 % éch. 25/06/2035	6 091	5 057	0,01
5,805 % éch. 25/04/2036 ^	511	441	0,00
5,889 % éch. 25/10/2034	624	617	0,00
5,971 % éch. 25/09/2046 ^	1 262	1 254	0,00
5,989 % éch. 25/10/2046 ^	79	73	0,00
6,039 % éch. 25/06/2035	2 077	2 027	0,00
6,339 % éch. 25/08/2035	5 617	5 155	0,01
6,489 % éch. 25/08/2035	730	531	0,00
6,770 % éch. 25/10/2046 ^	8 582	5 939	0,01
6,789 % éch. 25/10/2034	534	516	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.			
4,889 % éch. 25/10/2034	3 372	3 169	0,01
4,929 % éch. 25/12/2034	5 427	5 113	0,01
5,109 % éch. 25/07/2034	648	635	0,00
5,244 % éch. 25/08/2034	584	575	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates, Inc.			
5,129 % éch. 25/08/2047	13 879	13 377	0,02
5,171 % éch. 25/03/2035	6 376	6 172	0,01
5,739 % éch. 25/04/2035	66	66	0,00
5,889 % éch. 25/02/2035	7 365	7 254	0,01
Countrywide Asset-Backed Securities Notes Trust			
6,389 % éch. 25/08/2047	159	157	0,00
Countrywide Revolving Home Equity Loan Trust			
4,498 % éch. 15/05/2036	993	964	0,00
4,518 % éch. 15/05/2036	763	721	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization CBO Ltd.			
4,914 % éch. 16/02/2041	54 641	1 086	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC			
2,801 % éch. 25/05/2036	3 702	2 435	0,00
3,024 % éch. 25/12/2036 ^	4 326	3 383	0,01
3,207 % éch. 25/03/2034	369	362	0,00
3,221 % éch. 25/12/2035	563	548	0,00
3,528 % éch. 25/04/2037	4 765	2 955	0,01
4,689 % éch. 25/10/2036	3 039	2 475	0,00
4,718 % éch. 25/12/2037	791	828	0,00
7,764 % éch. 25/01/2033 ^	299	265	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust			
3,241 % éch. 25/03/2037 ^	112	43	0,00
3,547 % éch. 25/02/2037 ^	719	441	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust			
3,039 % éch. 25/07/2036	2 285	2 127	0,00
3,103 % éch. 25/01/2037 ^	4 209	1 347	0,00
4,609 % éch. 25/11/2036	10 655	5 081	0,01
4,689 % éch. 25/11/2036	2 501	1 193	0,00
4,849 % éch. 25/11/2036	867	413	0,00
4,869 % éch. 25/10/2036	10 248	6 830	0,01
CSAB Mortgage-Backed Trust			
4,476 % éch. 25/11/2036	8 000	1 304	0,00
5,858 % éch. 25/05/2037	5 525	1 443	0,00
5,898 % éch. 25/05/2037 ^	830	217	0,00
6,580 % éch. 25/09/2036	2 188	747	0,00
CVC Cordatus Loan Fund DAC			
2,112 % éch. 21/07/2030	€ 37 690	39 432	0,07
2,842 % éch. 20/08/2034	5 000	5 141	0,01
3,135 % éch. 23/10/2034	10 600	11 117	0,02
Dryden CLO Ltd.			
5,164 % éch. 18/04/2031	$ 6 600	$ 6 464	0,01
Dryden Euro CLO BV			
2,128 % éch. 15/07/2032	€ 995	1 036	0,00
Dryden Euro CLO DAC			
2,188 % éch. 15/01/2032	3 596	3 760	0,01
2,258 % éch. 15/04/2034	3 000	3 061	0,01
Dryden Senior Loan Fund			
5,049 % éch. 15/04/2031	$ 22 350	21 991	0,04
ECMC Group Student Loan Trust			
5,439 % éch. 25/05/2067	16 182	15 602	0,03
EFS Volunteer LLC			
5,208 % éch. 25/10/2035	1 217	1 212	0,00
Ellington Loan Acquisition Trust			
5,439 % éch. 25/05/2037	10 485	9 956	0,02
5,489 % éch. 25/05/2037	11 292	10 869	0,02
5,889 % éch. 25/05/2037	1 649	1 581	0,00
Encore Credit Receivables Trust			
5,124 % éch. 25/07/2035	1 899	1 716	0,00
5,289 % éch. 25/01/2036	1 000	955	0,00
5,319 % éch. 25/11/2035	5 003	4 531	0,01
5,364 % éch. 25/01/2036	5 000	4 422	0,01
5,409 % éch. 25/07/2035	2 138	1 907	0,00
EquiFirst Loan Securitization Trust			
4,559 % éch. 25/04/2037	1 501	1 276	0,00
EquiFirst Mortgage Loan Trust			
6,189 % éch. 25/04/2035	2 091	1 771	0,00
7,014 % éch. 25/12/2034	657	569	0,00
7,764 % éch. 25/10/2034	1 104	1 017	0,00
FAB CBO BV			
1,826 % éch. 20/08/2080	€ 400	423	0,00
FBR Securitization Trust			
5,124 % éch. 25/11/2035	$ 11 731	10 512	0,02
Fidelity Grand Harbour CLO DAC			
3,246 % éch. 15/03/2032	€ 5 196	5 393	0,01
Fieldstone Mortgage Investment Trust			
4,256 % éch. 25/11/2036	$ 3 346	1 971	0,00
4,296 % éch. 25/11/2036	8 456	7 722	0,01
4,496 % éch. 25/11/2036	2 675	1 575	0,00
4,661 % éch. 25/02/2036	11 705	10 300	0,02
4,769 % éch. 25/05/2036	7 322	5 024	0,01
6,414 % éch. 25/02/2035	1 300	1 226	0,00
Finance America Mortgage Loan Trust			
5,334 % éch. 25/11/2034	629	543	0,00
5,409 % éch. 25/11/2034	459	395	0,00
First Franklin Mortgage Loan Trust			
4,129 % éch. 25/03/2036	2 199	2 176	0,00
4,489 % éch. 25/03/2037	5 195	2 628	0,01
4,499 % éch. 25/12/2037	607	565	0,00
4,509 % éch. 25/11/2036	7 578	6 980	0,01
4,509 % éch. 25/12/2036	8 410	7 730	0,01
4,539 % éch. 25/03/2037	654	332	0,00
4,549 % éch. 25/10/2036	5 903	5 770	0,01
4,549 % éch. 25/11/2036	9 865	9 642	0,02
4,549 % éch. 25/12/2037	8 439	7 510	0,01
4,599 % éch. 25/12/2037	12 463	11 120	0,02
4,669 % éch. 25/12/2036	14 070	6 118	0,01
4,689 % éch. 25/08/2036	179	166	0,00
4,699 % éch. 25/07/2036	3 939	3 701	0,01
4,699 % éch. 25/09/2036	5 946	5 432	0,01
4,709 % éch. 25/04/2036	6 499	6 279	0,01
4,709 % éch. 25/06/2036	5 896	5 703	0,01
4,869 % éch. 25/08/2036	7 522	7 004	0,01
4,869 % éch. 25/10/2036	13 917	9 539	0,02
4,989 % éch. 25/02/2036	4 141	3 775	0,01
5,064 % éch. 25/11/2035	1 486	1 442	0,00
5,079 % éch. 25/01/2036	3 874	3 517	0,01
5,094 % éch. 25/05/2036	369	368	0,00
5,109 % éch. 25/10/2035	129	129	0,00
5,109 % éch. 25/11/2035	2 614	2 398	0,00
5,139 % éch. 25/12/2035	4 306	4 070	0,01
5,214 % éch. 25/06/2034	581	574	0,00
5,289 % éch. 25/07/2035	1 234	1 208	0,00
5,319 % éch. 25/07/2034	259	258	0,00
5,334 % éch. 25/03/2035	847	824	0,00
5,334 % éch. 25/09/2035	4 706	4 138	0,01
5,814 % éch. 25/10/2034	440	433	0,00
6,189 % éch. 25/09/2034	1 708	1 680	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
First NLC Trust				
4,459 % éch. 25/08/2037	$	6 192	$ 2 934	0,01
4,529 % éch. 25/08/2037		190	90	0,00
4,569 % éch. 25/08/2037		3 426	1 624	0,00
4,669 % éch. 25/08/2037		47	23	0,00
5,124 % éch. 25/02/2036		5 420	4 625	0,01
Fremont Home Loan Trust				
4,524 % éch. 25/10/2036		11 862	10 471	0,02
4,529 % éch. 25/01/2037		21 976	11 012	0,02
4,539 % éch. 25/10/2036		12 705	5 373	0,01
4,589 % éch. 25/08/2036		6 904	2 394	0,00
4,609 % éch. 25/11/2036		6 774	2 528	0,01
4,669 % éch. 25/02/2037		13 926	10 781	0,02
4,709 % éch. 25/05/2036		8 892	5 193	0,01
4,729 % éch. 25/02/2036		4 018	3 808	0,01
4,929 % éch. 25/02/2036		300	252	0,00
5,004 % éch. 25/11/2035		5 829	5 095	0,01
5,049 % éch. 25/01/2036		1 503	1 393	0,00
5,064 % éch. 25/01/2036		6 546	4 699	0,01
5,069 % éch. 25/11/2035		382	374	0,00
5,139 % éch. 25/06/2035		1 235	1 199	0,00
5,169 % éch. 25/07/2035		2 012	1 911	0,00
5,259 % éch. 25/05/2034		811	747	0,00
5,319 % éch. 25/07/2035		2 103	1 761	0,00
5,409 % éch. 25/01/2035		3 126	2 685	0,01
5,439 % éch. 25/11/2034		1 695	1 580	0,00
5,454 % éch. 25/06/2035		4 496	4 283	0,01
6,144 % éch. 25/05/2034 ^		23	27	0,00
GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,029 % éch. 25/12/2035		446	418	0,00
5,049 % éch. 25/10/2035		80	75	0,00
5,049 % éch. 25/12/2035		1 690	1 328	0,00
GE-WMC Mortgage Securities Trust				
4,649 % éch. 25/08/2036		7 272	6 665	0,01
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				
2,186 % éch. 20/10/2030	€	1 000	1 041	0,00
Goodgreen Trust				
3,930 % éch. 15/10/2053	$	11 781	10 857	0,02
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				
5,498 % éch. 15/09/2037		34 814	34 287	0,06
GSAA Home Equity Trust				
4,489 % éch. 25/09/2036		4 138	1 009	0,00
4,489 % éch. 25/12/2046		2 540	1 305	0,00
4,509 % éch. 25/11/2036		5 137	1 344	0,00
4,529 % éch. 25/12/2046		7 163	2 196	0,00
4,549 % éch. 25/02/2037		6 161	2 010	0,00
4,569 % éch. 25/07/2036		1 323	304	0,00
4,589 % éch. 25/03/2037		8 121	2 494	0,00
4,709 % éch. 25/06/2036		4 449	1 016	0,00
4,729 % éch. 25/09/2036		5 630	1 383	0,00
4,729 % éch. 25/03/2047		20 004	6 049	0,01
4,749 % éch. 25/03/2036		11 942	4 487	0,01
4,749 % éch. 25/12/2036		13 274	3 768	0,01
4,769 % éch. 25/03/2036		6 050	2 241	0,00
4,869 % éch. 25/11/2036		4 552	1 690	0,00
4,989 % éch. 25/03/2036		3 426	1 879	0,00
4,989 % éch. 25/05/2047		117	79	0,00
5,109 % éch. 25/10/2035		3 005	2 498	0,00
5,124 % éch. 25/06/2035		2 442	2 300	0,00
5,149 % éch. 25/01/2036		465	41	0,00
5,334 % éch. 25/08/2035		1 604	1 430	0,00
5,558 % éch. 25/05/2035		336	323	0,00
5,676 % éch. 25/09/2035		3 412	2 315	0,00
5,788 % éch. 25/05/2037 ^		6 015	2 627	0,01
5,917 % éch. 25/03/2037 ^		2 358	493	0,00
6,000 % éch. 25/10/2037 ^		156	137	0,00
6,300 % éch. 25/03/2037 ^		5 758	1 448	0,00
6,376 % éch. 25/09/2036		729	209	0,00
6,459 % éch. 25/09/2036 ^		4 878	1 396	0,00
6,483 % éch. 25/03/2037 ^		5 411	1 649	0,00
6,500 % éch. 25/10/2037		1 154	648	0,00
6,599 % éch. 25/03/2037		2 131	533	0,00
GSAMP Trust				
3,312 % éch. 25/11/2034		1 136	1 086	0,00
4,439 % éch. 25/12/2046		312	156	0,00
4,469 % éch. 25/08/2036		2 283	1 832	0,00
4,489 % éch. 25/12/2046		1 400	703	0,00
4,509 % éch. 25/12/2036		5 033	2 518	0,00
4,529 % éch. 25/11/2036		4 987	2 405	0,00
4,529 % éch. 25/03/2047		6 228	5 586	0,01
4,539 % éch. 25/12/2046		472	237	0,00
4,549 % éch. 25/01/2037	$	15 935	$ 9 685	0,02
4,559 % éch. 25/12/2036		7 368	3 686	0,01
4,559 % éch. 25/01/2037		5 284	5 059	0,01
4,589 % éch. 25/11/2036		1 217	590	0,00
4,619 % éch. 25/12/2046		697	349	0,00
4,629 % éch. 25/09/2036		18 251	6 757	0,01
4,659 % éch. 25/03/2047		6 084	5 578	0,01
4,669 % éch. 25/06/2036		1 928	1 841	0,00
4,689 % éch. 25/08/2036		1 724	1 689	0,00
4,689 % éch. 25/12/2036		1 358	1 281	0,00
4,709 % éch. 25/04/2036		4 970	3 177	0,01
4,709 % éch. 25/05/2046		19	19	0,00
4,759 % éch. 25/03/2047		3 302	2 460	0,00
4,764 % éch. 25/10/2046		6 000	4 938	0,01
4,869 % éch. 25/06/2036		2 134	1 146	0,00
4,869 % éch. 25/03/2046		274	264	0,00
4,909 % éch. 25/02/2046		787	719	0,00
4,929 % éch. 25/02/2036		103	95	0,00
4,974 % éch. 25/01/2036		871	873	0,00
5,004 % éch. 25/01/2036		2 504	2 193	0,00
5,034 % éch. 25/11/2035 ^		4 561	3 958	0,01
5,274 % éch. 25/07/2045 ^		7 074	6 534	0,01
5,289 % éch. 25/11/2035 ^		4 239	3 943	0,01
5,364 % éch. 25/04/2035 ^		2 141	2 008	0,00
5,439 % éch. 25/06/2034		455	415	0,00
7,764 % éch. 25/02/2047		1 500	1 402	0,00
Harvest CLO DAC				
1,100 % éch. 18/11/2029	€	351	369	0,00
2,228 % éch. 15/01/2032		23 100	23 888	0,04
2,433 % éch. 18/11/2029		3 099	3 263	0,01
Hildene TruPS Financials Note Securitization Ltd.				
5,269 % éch. 10/10/2038	$	24 145	22 366	0,04
Home Equity Asset Trust				
3,826 % éch. 25/02/2036		3 827	3 682	0,01
4,689 % éch. 25/11/2036		1 619	1 572	0,00
4,859 % éch. 25/01/2036		2 913	2 743	0,01
4,869 % éch. 25/10/2036		4 431	2 688	0,01
4,989 % éch. 25/07/2036		1 800	1 601	0,00
5,049 % éch. 25/04/2036		2 528	2 208	0,00
5,184 % éch. 25/11/2035		861	848	0,00
5,229 % éch. 25/01/2035		827	796	0,00
5,289 % éch. 25/12/2034		138	138	0,00
5,334 % éch. 25/11/2035		523	488	0,00
5,634 % éch. 25/05/2035		1 048	966	0,00
5,889 % éch. 25/03/2035		867	805	0,00
6,039 % éch. 25/12/2034		575	554	0,00
6,089 % éch. 25/11/2034		524	510	0,00
6,139 % éch. 25/11/2034		407	391	0,00
Home Equity Loan Trust				
4,619 % éch. 25/04/2037		462	445	0,00
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
4,509 % éch. 25/04/2037		5 909	4 118	0,01
4,529 % éch. 25/11/2036		5 695	5 083	0,01
4,549 % éch. 25/11/2036		3 989	3 416	0,01
4,559 % éch. 25/04/2037		3 153	2 198	0,00
4,579 % éch. 25/04/2037		9 982	6 601	0,01
4,579 % éch. 25/07/2037		8 123	3 333	0,01
4,589 % éch. 25/07/2037		9 441	5 113	0,01
4,629 % éch. 25/11/2036		602	483	0,00
4,629 % éch. 25/04/2037		10 860	7 183	0,01
4,749 % éch. 25/06/2036		3 054	2 918	0,01
4,769 % éch. 25/06/2036		55	54	0,00
4,869 % éch. 25/08/2036		5 732	4 865	0,01
5,049 % éch. 25/03/2036		5 566	5 106	0,01
5,454 % éch. 25/08/2035		1 800	1 673	0,00
5,634 % éch. 25/03/2035		3 290	3 172	0,01
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
4,539 % éch. 25/12/2036		2 742	2 437	0,00
4,579 % éch. 25/01/2037		13 688	9 824	0,02
4,609 % éch. 25/12/2036		16 507	7 132	0,01
4,649 % éch. 25/04/2037		12 300	6 536	0,01
4,764 % éch. 25/05/2037		4 990	4 765	0,01
4,829 % éch. 25/12/2036		17 900	4 874	0,01
4,914 % éch. 25/02/2036		3 065	2 601	0,01
4,929 % éch. 25/12/2035		700	693	0,00
5,004 % éch. 25/01/2036		8 126	7 645	0,01
Humboldt Americas LLC				
0,000 % éch. 31/07/2022	COP	20 000 000	3 990	0,01
ICG Euro CLO DAC				
2,150 % éch. 15/10/2034	€	6 000	$ 5 075	0,01
IndyMac Manufactured Housing Contract Pass-Through Certificates				
6,750 % éch. 25/02/2028	$	9	9	0,00
IXIS Real Estate Capital Trust				
4,449 % éch. 25/05/2037		21 636	5 618	0,01
4,689 % éch. 25/01/2037		13 997	5 537	0,01
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.				
2,808 % éch. 25/10/2035 ^		561	543	0,00
2,808 % éch. 25/10/2035		4 786	3 960	0,01
4,899 % éch. 25/02/2036 ^		2 633	2 559	0,01
4,929 % éch. 25/02/2036 ^		2 711	2 310	0,00
4,929 % éch. 25/03/2036		6 484	5 913	0,01
4,969 % éch. 25/01/2036		33	33	0,00
5,019 % éch. 25/05/2035 ^		7 352	6 566	0,01
5,094 % éch. 25/09/2035		178	175	0,00
5,139 % éch. 25/06/2035		5 208	5 054	0,01
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
3,773 % éch. 25/07/2036		2 380	2 319	0,00
3,893 % éch. 25/11/2036		4 423	3 848	0,01
4,072 % éch. 25/11/2036		5 085	4 932	0,01
4,442 % éch. 25/01/2037 ^		2 655	1 474	0,00
4,469 % éch. 25/12/2036		3 160	1 715	0,00
4,539 % éch. 25/12/2036		5 773	3 151	0,01
4,569 % éch. 25/07/2036		515	235	0,00
4,579 % éch. 25/03/2047		2 120	2 096	0,00
4,599 % éch. 25/10/2036		4 746	4 665	0,01
4,619 % éch. 25/05/2037		2 290	2 190	0,00
4,629 % éch. 25/05/2037		9 549	9 457	0,02
4,649 % éch. 25/03/2037		3 064	2 983	0,01
4,649 % éch. 25/06/2037		3 500	3 477	0,01
4,659 % éch. 25/08/2036		6 700	5 957	0,01
4,679 % éch. 25/07/2036		784	779	0,00
4,689 % éch. 25/01/2037		336	322	0,00
4,689 % éch. 25/03/2037		7 847	7 351	0,01
4,794 % éch. 25/05/2036		2 629	2 539	0,01
4,794 % éch. 25/07/2036		3 224	3 121	0,01
4,824 % éch. 25/05/2036		5 191	4 933	0,01
4,829 % éch. 25/07/2036		1 798	1 587	0,00
4,839 % éch. 25/07/2036		3 786	3 114	0,01
4,899 % éch. 25/04/2036		5 628	4 377	0,01
4,919 % éch. 25/01/2037		5 706	4 922	0,01
6,630 % éch. 25/07/2036 ^		10 110	3 058	0,01
Kodiak CDO Ltd.				
3,343 % éch. 07/08/2037		4 465	4 338	0,01
Lehman ABS Manufactured Housing Contract Trust				
6,630 % éch. 15/04/2040		3 335	3 306	0,01
Lehman XS Trust				
3,795 % éch. 25/06/2036		8	8	0,00
4,589 % éch. 25/02/2037		10 515	9 018	0,02
4,699 % éch. 25/03/2037		2 580	2 312	0,00
4,709 % éch. 25/05/2036		3 328	2 811	0,01
4,729 % éch. 25/10/2036		1 818	1 635	0,00
4,729 % éch. 25/12/2036		4 227	3 547	0,01
4,809 % éch. 25/06/2046		4 638	4 137	0,01
4,849 % éch. 25/02/2037		5 430	4 100	0,01
4,909 % éch. 25/05/2046 ^		1 650	1 441	0,00
4,909 % éch. 25/02/2047		2 141	1 889	0,00
4,969 % éch. 25/09/2036		4 303	3 617	0,01
5,049 % éch. 25/01/2036 ^		2 143	1 971	0,00
6,390 % éch. 25/04/2036 ^		31	39	0,00
6,689 % éch. 25/12/2037		1 017	999	0,00
6,790 % éch. 24/06/2046		716	772	0,00
Long Beach Mortgage Loan Trust				
4,499 % éch. 25/11/2036		335	104	0,00
4,539 % éch. 25/11/2036		15 784	11 132	0,02
4,549 % éch. 25/12/2036		23 886	16 420	0,03
4,569 % éch. 25/09/2036		13 654	3 907	0,01
4,589 % éch. 25/07/2036		6 354	2 601	0,01
4,619 % éch. 25/12/2036		1 443	551	0,00
4,629 % éch. 25/08/2036		19 867	8 478	0,02
4,679 % éch. 25/07/2036		5 106	3 692	0,01
4,689 % éch. 25/05/2036		9 899	5 760	0,01
4,689 % éch. 25/07/2036		2 471	1 014	0,00
4,689 % éch. 25/09/2036		821	524	0,00
4,709 % éch. 25/05/2036		11 364	3 596	0,01
4,709 % éch. 25/08/2036		2 523	1 079	0,00
4,709 % éch. 25/09/2036		10 618	3 049	0,01
4,709 % éch. 25/10/2036		29 175	9 329	0,02
4,709 % éch. 25/05/2046		13 846	12 502	0,02

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,749 % éch. 25/03/2046	$ 20 998	$ 17 243	0,03
4,769 % éch. 25/03/2046	2 747	1 013	0,00
4,869 % éch. 25/08/2036	3 110	1 334	0,00
4,909 % éch. 25/08/2045	584	557	0,00
4,949 % éch. 25/10/2034	5 002	4 582	0,01
4,989 % éch. 25/01/2036	12 778	11 533	0,02
4,989 % éch. 25/02/2036	12 091	9 945	0,02
5,169 % éch. 25/08/2035	7 525	7 342	0,01
5,184 % éch. 25/06/2034	2 391	2 280	0,00
5,439 % éch. 25/06/2035	5 767	5 585	0,01
5,514 % éch. 25/04/2035	2 500	2 344	0,00
5,539 % éch. 25/09/2034	1 384	1 339	0,00
5,814 % éch. 25/02/2035	6 916	6 266	0,01
Man GLG Euro CLO DAC			
2,058 % éch. 15/10/2030	€ 9 857	10 276	0,02
2,118 % éch. 15/10/2030	12 666	13 199	0,02
2,188 % éch. 15/10/2032	7 496	7 740	0,01
2,248 % éch. 15/01/2030	14 291	14 913	0,03
MAPS Ltd.			
4,212 % éch. 15/05/2043	$ 21 991	19 660	0,03
Marlay Park CLO DAC			
2,118 % éch. 15/10/2030	€ 3 250	3 391	0,01
MASTR Asset-Backed Securities Trust			
4,439 % éch. 25/10/2036	$ 4 082	1 330	0,00
4,534 % éch. 25/01/2037	22 700	6 716	0,01
4,539 % éch. 25/10/2036	960	315	0,00
4,559 % éch. 25/10/2036	432	430	0,00
4,589 % éch. 25/08/2036	8 529	3 035	0,01
4,589 % éch. 25/10/2036	5 584	2 946	0,01
4,599 % éch. 25/05/2037	7 332	6 907	0,01
4,649 % éch. 25/10/2036	530	264	0,00
4,659 % éch. 25/08/2036	7 520	2 923	0,01
4,689 % éch. 25/04/2036	2 170	578	0,00
4,689 % éch. 25/06/2036	2 140	851	0,00
4,689 % éch. 25/08/2036	14 466	5 415	0,01
4,709 % éch. 25/10/2036	7 310	3 856	0,01
4,829 % éch. 25/11/2036	9 668	5 897	0,01
4,869 % éch. 25/03/2036	3 218	2 273	0,00
4,869 % éch. 25/08/2036	4 135	1 491	0,00
4,889 % éch. 25/11/2035	1 815	1 049	0,00
4,959 % éch. 25/01/2036	2 598	2 538	0,01
5,079 % éch. 25/03/2035	94	94	0,00
5,089 % éch. 25/09/2034	2 281	1 939	0,00
5,139 % éch. 25/10/2035 ^	4 976	4 596	0,01
5,394 % éch. 25/03/2035	2 260	2 180	0,00
5,539 % éch. 25/08/2037	6 854	5 685	0,01
6,114 % éch. 25/06/2035	130	127	0,00
6,924 % éch. 25/06/2035	2 159	2 068	0,00
MASTR Specialized Loan Trust			
4,649 % éch. 25/06/2046	1 591	1 505	0,00
4,759 % éch. 25/01/2037	4 028	1 616	0,00
6,478 % éch. 25/07/2035	451	423	0,00
Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust			
4,669 % éch. 25/04/2037	675	311	0,00
4,749 % éch. 25/06/2037	698	543	0,00
5,389 % éch. 25/10/2037	7 165	6 135	0,01
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
4,539 % éch. 25/08/2037	3 127	2 912	0,01
4,609 % éch. 25/07/2037	6 375	2 909	0,01
4,629 % éch. 25/02/2037	4 074	1 244	0,00
4,669 % éch. 25/05/2037	5 426	3 029	0,01
4,669 % éch. 25/11/2037	8 237	4 087	0,01
4,689 % éch. 25/06/2037	3 659	1 001	0,00
4,689 % éch. 25/08/2037	12 458	8 098	0,01
4,709 % éch. 25/03/2037	11 604	10 398	0,02
4,709 % éch. 25/07/2037	3 279	1 962	0,00
4,769 % éch. 25/04/2047	6 477	2 887	0,01
4,839 % éch. 25/02/2047	216	131	0,00
4,889 % éch. 25/07/2037	386	100	0,00
4,909 % éch. 25/03/2037	2 684	867	0,00
4,909 % éch. 25/07/2037	5 569	2 578	0,01
4,989 % éch. 25/12/2036	2 861	2 687	0,01
4,989 % éch. 25/01/2037	5 688	5 148	0,01
5,319 % éch. 25/07/2035	890	861	0,00
5,469 % éch. 25/10/2035	169	166	0,00
5,514 % éch. 25/08/2036	4 838	4 826	0,01
METAL Cayman Ltd.			
4,581 % éch. 15/10/2042	27 947	14 688	0,03
MMcapS Funding Ltd.			
5,111 % éch. 01/12/2035	3 009	2 955	0,01
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
3,549 % éch. 25/01/2035	$ 2 018	$ 1 884	0,00
4,459 % éch. 25/10/2036	2 937	1 448	0,00
4,479 % éch. 25/01/2037	16 542	8 191	0,01
4,489 % éch. 25/07/2036	6 607	2 666	0,01
4,489 % éch. 25/10/2036	1 399	671	0,00
4,499 % éch. 25/10/2036	5 264	2 600	0,01
4,499 % éch. 25/12/2036	3 793	1 983	0,00
4,499 % éch. 25/02/2037	3 336	1 128	0,00
4,499 % éch. 25/03/2037	435	196	0,00
4,519 % éch. 25/02/2037	77	69	0,00
4,529 % éch. 25/10/2036	14 399	6 911	0,01
4,529 % éch. 25/05/2037	25 385	20 134	0,04
4,539 % éch. 25/12/2036	11 213	5 863	0,01
4,539 % éch. 25/02/2037	5 006	2 440	0,00
4,589 % éch. 25/05/2037	7 561	4 039	0,01
4,599 % éch. 25/01/2037	5 273	2 614	0,01
4,639 % éch. 25/07/2036	8 335	7 053	0,01
4,639 % éch. 25/12/2036	0	0	0,00
4,639 % éch. 25/03/2037	2 239	1 012	0,00
4,649 % éch. 25/02/2037	865	422	0,00
4,689 % éch. 25/06/2036	3 264	1 714	0,00
4,689 % éch. 25/07/2036	3 497	1 425	0,00
4,709 % éch. 25/09/2036	3 876	1 753	0,00
4,719 % éch. 25/02/2037	13 087	6 383	0,01
4,869 % éch. 25/06/2036	23 833	16 812	0,03
4,869 % éch. 25/09/2036	24 874	9 578	0,02
4,884 % éch. 25/03/2036	6 827	5 836	0,01
4,889 % éch. 25/04/2036	9 455	8 849	0,02
4,889 % éch. 25/07/2036	1 660	682	0,00
4,959 % éch. 25/12/2035	6 235	5 179	0,01
5,049 % éch. 25/01/2035	3 887	3 752	0,01
5,049 % éch. 25/11/2035	6 571	6 239	0,01
5,064 % éch. 25/12/2034	688	665	0,00
5,064 % éch. 25/09/2035	4 865	4 558	0,01
5,094 % éch. 25/12/2034	436	410	0,00
5,129 % éch. 25/01/2034	1 787	1 711	0,00
5,214 % éch. 25/08/2034	571	547	0,00
5,289 % éch. 25/08/2034	1 143	1 065	0,00
5,304 % éch. 25/07/2034	423	412	0,00
5,304 % éch. 25/03/2035	495	485	0,00
5,319 % éch. 25/11/2034	998	982	0,00
5,319 % éch. 25/02/2035	2 766	2 475	0,00
5,334 % éch. 25/01/2035	4 813	4 217	0,01
5,364 % éch. 25/04/2035	91	91	0,00
5,389 % éch. 25/07/2037	7 210	6 994	0,01
5,409 % éch. 25/08/2034	117	110	0,00
5,439 % éch. 25/04/2035	292	270	0,00
5,439 % éch. 25/06/2035 ^	3 175	2 838	0,01
5,544 % éch. 25/12/2034	1	1	0,00
5,639 % éch. 25/07/2037	8 600	7 159	0,01
6,189 % éch. 25/05/2034	602	569	0,00
7,014 % éch. 25/03/2034	794	727	0,00
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust			
4,929 % éch. 25/02/2036	3 567	3 062	0,01
4,929 % éch. 25/03/2036	9 870	7 998	0,01
4,944 % éch. 25/01/2036	2 869	2 144	0,00
4,969 % éch. 25/01/2036	1 618	1 548	0,00
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust			
4,559 % éch. 25/04/2037	17 082	9 356	0,02
4,709 % éch. 25/04/2036	6 942	4 961	0,01
4,899 % éch. 25/02/2036	5 534	4 975	0,01
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust			
4,439 % éch. 25/11/2036	1	0	0,00
4,459 % éch. 25/11/2036	6 987	2 441	0,00
4,539 % éch. 25/11/2036	5 745	2 008	0,00
4,609 % éch. 25/11/2036	1 572	550	0,00
4,689 % éch. 25/07/2036	13 805	5 962	0,01
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
4,549 % éch. 25/11/2036	1 423	444	0,00
4,629 % éch. 25/04/2037	15 124	4 516	0,01
4,729 % éch. 25/10/2036	8 231	2 549	0,01
4,729 % éch. 25/11/2036	1 517	471	0,00
4,729 % éch. 25/01/2047 ^	3 810	1 262	0,00
4,869 % éch. 25/04/2037	3 627	1 084	0,00
4,929 % éch. 25/04/2037	15 966	6 439	0,01
6,077 % éch. 25/10/2046 ^	4 404	1 099	0,00
6,250 % éch. 25/02/2037	4 483	3 085	0,01
6,263 % éch. 25/01/2047	1 263	400	0,00
6,298 % éch. 25/10/2036 ^	8 988	2 187	0,00
6,326 % éch. 25/09/2046	11 770	2 836	0,01
6,488 % éch. 25/11/2036 ^	6 371	1 489	0,00
Morgan Stanley Structured Trust			
4,619 % éch. 25/06/2037	$ 147	$ 147	0,00
Mountain View CLO LLC			
5,169 % éch. 16/10/2029	46 709	46 211	0,08
Nassau Ltd.			
5,229 % éch. 15/10/2029	17 117	16 900	0,03
National Collegiate Student Loan Trust			
4,699 % éch. 25/05/2032	7 632	7 298	0,01
4,709 % éch. 27/10/2031	12 427	12 177	0,02
4,739 % éch. 25/03/2033	9 401	8 942	0,02
4,759 % éch. 25/06/2033	3 312	3 105	0,01
Nationstar Home Equity Loan Trust			
4,564 % éch. 25/06/2037	3 286	3 201	0,01
4,709 % éch. 25/04/2037	7 992	7 741	0,01
Navient Private Education Loan Trust			
2,650 % éch. 15/12/2028	1 980	1 961	0,00
2,740 % éch. 15/02/2029	112	112	0,00
5,768 % éch. 16/07/2040	15 051	14 844	0,03
6,468 % éch. 15/12/2045	7 155	7 220	0,01
New Century Home Equity Loan Trust			
4,549 % éch. 25/08/2036	6 421	6 198	0,01
5,034 % éch. 25/12/2035	7 106	6 717	0,01
5,064 % éch. 25/03/2035	2 657	2 600	0,01
5,109 % éch. 25/03/2035	4 567	4 367	0,01
5,124 % éch. 25/10/2035	8 361	6 896	0,01
5,154 % éch. 25/02/2035	4 278	4 094	0,01
5,334 % éch. 25/06/2035	1 169	1 145	0,00
5,334 % éch. 25/09/2035	7 903	7 662	0,01
5,364 % éch. 25/11/2034	303	294	0,00
5,364 % éch. 25/06/2035	6 567	6 197	0,01
5,394 % éch. 25/07/2035	12 000	11 729	0,02
5,454 % éch. 25/03/2035	342	311	0,00
Newcastle Mortgage Securities Trust			
4,619 % éch. 25/04/2037	11 172	10 940	0,02
5,064 % éch. 25/03/2036	6 394	6 238	0,01
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust			
4,669 % éch. 25/07/2036	10 729	8 748	0,02
4,719 % éch. 25/10/2036 ^	7 226	1 637	0,00
4,789 % éch. 25/02/2037 ^	10 051	3 194	0,01
4,869 % éch. 25/03/2036	2 393	2 210	0,00
4,884 % éch. 25/03/2036	5 146	4 744	0,01
5,049 % éch. 25/11/2035	4 443	4 185	0,01
5,154 % éch. 25/05/2035	1 832	1 784	0,00
5,992 % éch. 25/02/2037 ^	5 377	1 556	0,00
6,032 % éch. 25/10/2036 ^	2 696	679	0,00
NovaStar Mortgage Funding Trust			
4,539 % éch. 25/03/2037	3 157	1 131	0,00
4,559 % éch. 25/01/2037	23 288	8 301	0,02
4,569 % éch. 25/03/2037	27 142	9 726	0,02
4,569 % éch. 25/09/2037	3 655	3 312	0,01
4,589 % éch. 25/09/2037	10 808	10 438	0,02
4,689 % éch. 25/06/2036	2 910	2 237	0,00
4,689 % éch. 25/09/2036	5 284	2 305	0,00
4,709 % éch. 25/05/2036	3 445	3 364	0,01
5,079 % éch. 25/01/2036	5 700	5 102	0,01
5,094 % éch. 25/01/2036	1 285	1 260	0,00
5,109 % éch. 25/10/2035	3 220	3 161	0,01
5,124 % éch. 25/01/2036	5 000	4 650	0,01
5,214 % éch. 25/06/2034	466	457	0,00
6,114 % éch. 25/12/2034	770	706	0,00
6,264 % éch. 25/03/2035	3 503	3 413	0,01
Oakwood Mortgage Investors, Inc.			
5,050 % éch. 15/11/2019	147	136	0,00
6,990 % éch. 15/12/2026	44	44	0,00
Option One Mortgage Loan Trust			
4,509 % éch. 25/03/2037	6 603	6 218	0,01
4,519 % éch. 25/07/2037	11 539	6 539	0,01
4,529 % éch. 25/01/2037	17 405	11 592	0,02
4,529 % éch. 25/02/2037	20 273	13 640	0,02
4,529 % éch. 25/03/2037	14 269	8 149	0,01
4,559 % éch. 25/05/2037	20 518	11 297	0,02
4,569 % éch. 25/04/2037	678	327	0,00
4,569 % éch. 25/07/2037	4 800	2 721	0,01
4,579 % éch. 25/07/2037	1 874	1 508	0,00
4,609 % éch. 25/01/2037	7 505	4 474	0,01
4,609 % éch. 25/04/2037	35 173	25 108	0,04
4,609 % éch. 25/05/2037	5 213	3 180	0,01
4,639 % éch. 25/03/2037	2 588	1 275	0,00
4,929 % éch. 25/01/2036	20 829	18 452	0,03
5,124 % éch. 25/05/2035	3 000	2 777	0,01

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
5,124 % éch. 25/08/2035	$	519	$ 517	0,00
5,184 % éch. 25/05/2034		2 029	1 955	0,00
5,259 % éch. 25/05/2035		300	243	0,00
Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates				
5,079 % éch. 25/11/2035		2 644	2 514	0,00
Ownit Mortgage Loan Trust				
3,116 % éch. 25/12/2035 ^		1 071	623	0,00
OZLME DAC				
2,613 % éch. 24/08/2030	€	2 346	2 459	0,00
Palmer Square European CLO DAC				
1,970 % éch. 15/04/2035		6 000	5 055	0,01
Park Place Securities, Inc.				
5,124 % éch. 25/09/2035	$	6 614	6 445	0,01
5,334 % éch. 25/09/2035		2 506	2 303	0,00
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,124 % éch. 25/08/2035		7 486	7 150	0,01
5,124 % éch. 25/09/2035		7 625	7 299	0,01
5,184 % éch. 25/07/2035		3 989	3 913	0,01
5,334 % éch. 25/06/2035		1 141	1 130	0,00
5,394 % éch. 25/06/2035		1 500	1 404	0,00
5,439 % éch. 25/09/2034		4 404	4 295	0,01
5,439 % éch. 25/06/2035		1 992	1 626	0,00
5,514 % éch. 25/03/2035		999	961	0,00
5,709 % éch. 25/01/2036 ^		6 502	5 915	0,01
5,964 % éch. 25/02/2035		8 996	8 625	0,02
6,159 % éch. 25/10/2034		5 729	5 460	0,01
6,189 % éch. 25/12/2034		8 743	8 444	0,02
6,264 % éch. 25/12/2034		6 871	6 358	0,01
6,489 % éch. 25/09/2034		107	88	0,00
Penta CLO DAC				
2,493 % éch. 25/01/2033	€	10 000	10 380	0,02
People's Choice Home Loan Securities Trust				
4,871 % éch. 25/08/2035	$	6 374	5 952	0,01
4,961 % éch. 25/05/2035 ^		756	674	0,00
5,069 % éch. 25/12/2035 ^		7 960	7 533	0,01
People's Financial Realty Mortgage Securities Trust				
4,629 % éch. 25/09/2036		10 775	2 160	0,00
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust				
3,485 % éch. 25/11/2035		410	399	0,00
4,649 % éch. 25/11/2036		1 004	988	0,00
4,699 % éch. 25/06/2047 ^		936	860	0,00
4,884 % éch. 25/07/2036		2 425	2 262	0,00
4,974 % éch. 25/02/2036		947	930	0,00
Pretium Mortgage Credit Partners LLC				
2,240 % éch. 27/09/2060		12 541	11 484	0,02
Project Silver				
3,967 % éch. 15/07/2044		18 465	14 579	0,03
RAAC Trust				
4,659 % éch. 25/05/2036		351	348	0,00
4,889 % éch. 25/02/2037		2 606	2 415	0,00
4,989 % éch. 25/06/2044		1 284	1 056	0,00
5,039 % éch. 25/06/2047		1 989	1 923	0,00
5,079 % éch. 25/11/2036		508	504	0,00
5,149 % éch. 25/10/2046		2 181	2 061	0,00
5,244 % éch. 25/03/2037		1 019	1 010	0,00
5,589 % éch. 25/10/2045		339	339	0,00
Raptor Aircraft Finance LLC				
4,213 % éch. 23/08/2044		49 343	36 013	0,06
Ready Capital Mortgage Financing LLC				
6,539 % éch. 25/02/2035		9 162	8 951	0,02
Renaissance Home Equity Loan Trust				
4,759 % éch. 25/08/2035		1 747	1 549	0,00
5,149 % éch. 25/12/2032		42	39	0,00
5,285 % éch. 25/01/2037		2 814	916	0,00
5,294 % éch. 25/01/2037		18 457	6 021	0,01
5,512 % éch. 25/04/2037		8 724	2 593	0,01
5,545 % éch. 25/01/2037		2 357	805	0,00
5,612 % éch. 25/04/2037		5 992	1 812	0,00
5,675 % éch. 25/06/2037 ^		421	130	0,00
5,731 % éch. 25/11/2036		4 836	1 855	0,00
5,742 % éch. 25/04/2037		8 089	2 501	0,00
5,744 % éch. 25/06/2037 ^		5 934	1 853	0,00
5,762 % éch. 25/08/2036		8 258	3 325	0,01
5,797 % éch. 25/08/2036		12 841	5 201	0,01
5,812 % éch. 25/11/2036		8 748	3 401	0,01
5,857 % éch. 25/05/2035		2 136	1 799	0,00
5,879 % éch. 25/06/2037 ^		2 974	950	0,00
5,893 % éch. 25/06/2037 ^	$	28 633	$ 9 170	0,02
5,906 % éch. 25/06/2037		7 657	2 457	0,00
6,120 % éch. 25/11/2036		11 903	4 861	0,01
6,511 % éch. 25/07/2034		1 303	1 048	0,00
6,998 % éch. 25/09/2037 ^		9 523	4 471	0,01
7,238 % éch. 25/09/2037 ^		9 696	4 550	0,01
Residential Asset Mortgage Products Trust				
4,091 % éch. 25/05/2035		2 457	2 298	0,00
4,739 % éch. 25/10/2036		4 586	4 261	0,01
4,849 % éch. 25/12/2035		432	367	0,00
4,899 % éch. 25/03/2036		1 252	1 203	0,00
4,929 % éch. 25/02/2036		3 799	3 569	0,01
4,949 % éch. 25/07/2036		1 520	1 500	0,00
5,069 % éch. 25/12/2035		5 237	4 551	0,01
5,169 % éch. 25/07/2035		165	162	0,00
5,169 % éch. 25/09/2035		1 533	1 423	0,00
5,334 % éch. 25/10/2035		2 856	2 303	0,00
5,364 % éch. 25/07/2035		1 906	1 771	0,00
5,409 % éch. 25/05/2035		1 048	1 027	0,00
5,439 % éch. 25/08/2035		2 113	2 050	0,00
5,514 % éch. 25/06/2035		2 600	2 468	0,00
5,589 % éch. 25/01/2035 ^		2 577	2 334	0,00
Residential Asset Securities Corp. Trust				
4,083 % éch. 25/01/2037		3 934	3 766	0,01
4,336 % éch. 25/04/2034		520	495	0,00
4,564 % éch. 25/06/2034		2 038	1 960	0,00
4,596 % éch. 25/01/2037		6 801	5 749	0,01
4,609 % éch. 25/02/2037		7 150	6 790	0,01
4,649 % éch. 25/07/2036		50	49	0,00
4,669 % éch. 25/07/2036		4 312	4 038	0,01
4,669 % éch. 25/09/2036		4 213	4 079	0,01
4,729 % éch. 25/04/2037		3 953	3 704	0,01
4,809 % éch. 25/06/2036		184	183	0,00
4,824 % éch. 25/06/2036		3 422	3 230	0,01
4,899 % éch. 25/04/2036		5 275	4 524	0,01
4,929 % éch. 25/07/2036		2 511	2 174	0,00
4,949 % éch. 25/04/2036		1 325	1 303	0,00
4,974 % éch. 25/03/2036		2 996	2 945	0,01
4,989 % éch. 25/02/2036		1 288	1 260	0,00
5,004 % éch. 25/11/2035		100	94	0,00
5,019 % éch. 25/02/2036		3 752	3 477	0,01
5,034 % éch. 25/03/2035		224	222	0,00
5,049 % éch. 25/11/2035		1 135	1 130	0,00
5,049 % éch. 25/12/2035		3 988	3 787	0,01
5,069 % éch. 25/05/2037		1 417	1 399	0,00
5,079 % éch. 25/11/2035		969	952	0,00
5,094 % éch. 25/09/2035		915	852	0,00
5,094 % éch. 25/10/2035		2 047	1 652	0,00
5,094 % éch. 25/11/2035		476	455	0,00
5,109 % éch. 25/01/2036		4 882	4 705	0,01
5,259 % éch. 25/11/2035		3 825	2 968	0,01
5,349 % éch. 25/08/2035		3 494	3 422	0,01
5,424 % éch. 25/10/2035		2 013	1 917	0,00
5,634 % éch. 25/03/2035		1 010	958	0,00
6,189 % éch. 25/04/2035		653	603	0,00
Residential Funding Mortgage Securities Home Equity Loan Trust				
5,400 % éch. 25/12/2035 ^		1 548	376	0,00
RRE Loan Management DAC				
2,418 % éch. 15/10/2036	€	3 500	3 595	0,01
S-Jets Ltd.				
3,967 % éch. 15/08/2042	$	30 061	23 368	0,04
Sapphire Aviation Finance Ltd.				
4,250 % éch. 15/03/2040		33 662	26 157	0,05
Saranac CLO Ltd.				
6,353 % éch. 22/06/2030		32 421	31 968	0,06
Saxon Asset Securities Trust				
1,624 % éch. 25/11/2035		4 213	3 991	0,01
1,799 % éch. 25/05/2035		4 101	3 689	0,01
3,452 % éch. 25/08/2035		3 601	3 408	0,01
4,569 % éch. 25/05/2037		2 614	1 864	0,00
4,589 % éch. 25/05/2047		9 346	8 117	0,01
4,629 % éch. 25/10/2046		1 480	1 257	0,00
4,689 % éch. 25/09/2036 ^		7 983	6 108	0,01
4,699 % éch. 25/09/2037		10 347	9 732	0,02
4,789 % éch. 25/09/2047		3 750	3 413	0,01
4,879 % éch. 25/09/2047		5 418	4 229	0,01
5,049 % éch. 25/10/2035		3 979	3 748	0,01
5,109 % éch. 25/11/2037		2 500	1 980	0,00
6,139 % éch. 25/12/2037		7 472	6 354	0,01
SBA Tower Trust				
3,869 % éch. 15/10/2049		5 000	4 782	0,01
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
4,529 % éch. 25/01/2037	$	4 802	$ 4 218	0,01
4,549 % éch. 25/08/2036		2 818	921	0,00
4,589 % éch. 25/05/2037 ^		5 089	3 105	0,01
4,609 % éch. 25/01/2037		1 035	739	0,00
4,669 % éch. 25/05/2036		7 519	4 094	0,01
4,669 % éch. 25/06/2036		650	415	0,00
4,669 % éch. 25/09/2036		4 532	4 115	0,01
4,689 % éch. 25/03/2036		2 655	1 650	0,00
4,689 % éch. 25/09/2036		5 954	2 221	0,00
4,709 % éch. 25/09/2036		1 723	1 197	0,00
4,709 % éch. 25/10/2036		1 099	391	0,00
4,729 % éch. 25/08/2036 ^		12 467	4 072	0,01
4,869 % éch. 25/07/2036		7 641	2 727	0,01
4,929 % éch. 25/03/2036		502	447	0,00
4,989 % éch. 25/11/2035		3 775	3 070	0,01
5,034 % éch. 25/10/2035		1 467	1 265	0,00
5,064 % éch. 25/01/2035		565	519	0,00
5,109 % éch. 25/10/2035		1 750	1 524	0,00
5,274 % éch. 25/10/2035		2 927	2 376	0,00
5,349 % éch. 25/01/2036 ^		693	658	0,00
Segovia European CLO DAC				
2,336 % éch. 20/07/2032	€	4 600	4 753	0,01
SG Mortgage Securities Trust				
4,709 % éch. 25/07/2036	$	23 377	5 426	0,01
4,749 % éch. 25/02/2036		3 677	2 153	0,00
4,929 % éch. 25/02/2036		1 934	1 144	0,00
5,094 % éch. 25/10/2035		921	838	0,00
5,274 % éch. 25/10/2035		1 083	866	0,00
SLM Private Credit Student Loan Trust				
5,099 % éch. 15/06/2039		15 874	15 067	0,03
SLM Student Loan Trust				
1,943 % éch. 25/10/2039	€	2 517	2 548	0,01
2,093 % éch. 25/07/2039		14 284	14 607	0,03
2,093 % éch. 25/01/2040		24 600	24 161	0,04
2,596 % éch. 15/12/2033		2 152	2 192	0,00
5,858 % éch. 25/04/2023	$	16 693	16 601	0,03
6,058 % éch. 25/07/2023		8 396	8 315	0,02
SMB Private Education Loan Trust				
4,668 % éch. 16/02/2055		28 396	27 560	0,05
5,048 % éch. 15/01/2053		7 631	7 309	0,01
5,118 % éch. 15/02/2036		1 607	1 568	0,00
SoFi Alternative Trust				
5,059 % éch. 16/05/2050		18 774	18 089	0,03
5,297 % éch. 15/06/2050		18 033	17 237	0,03
SoFi Professional Loan Program LLC				
5,339 % éch. 25/01/2039		73	73	0,00
Soloso CDO Ltd.				
4,044 % éch. 07/10/2037		3 785	3 517	0,01
Soundview Home Loan Trust				
4,469 % éch. 25/06/2037		3 362	2 408	0,00
4,509 % éch. 25/11/2036		8 821	2 549	0,01
4,539 % éch. 25/03/2037		5 800	5 398	0,01
4,539 % éch. 25/06/2037		14 758	10 571	0,02
4,549 % éch. 25/01/2037		9 287	6 729	0,01
4,559 % éch. 25/07/2037		809	682	0,00
4,559 % éch. 25/08/2037		8 484	7 291	0,01
4,569 % éch. 25/07/2037		6 757	6 098	0,01
4,589 % éch. 25/02/2037		34 079	11 028	0,02
4,589 % éch. 25/06/2037		23 114	16 695	0,03
4,689 % éch. 25/07/2036		125	123	0,00
4,689 % éch. 25/01/2037		3 400	3 112	0,01
4,729 % éch. 25/11/2036		5 476	1 582	0,00
4,794 % éch. 25/12/2036		6 628	6 405	0,01
4,809 % éch. 25/06/2036 ^		5 598	4 675	0,01
4,854 % éch. 25/02/2036		4 064	3 697	0,01
4,854 % éch. 25/06/2036 ^		7 729	6 614	0,01
4,869 % éch. 25/07/2036		25 778	22 737	0,04
4,889 % éch. 25/06/2036		7 720	7 536	0,01
4,889 % éch. 25/10/2036		13 126	12 449	0,02
4,889 % éch. 25/11/2036		3 123	2 896	0,01
4,906 % éch. 25/03/2036		7 974	6 494	0,01
4,914 % éch. 25/03/2036		611	604	0,00
4,949 % éch. 25/10/2036		3 992	3 852	0,01
5,079 % éch. 25/12/2035		10 183	9 029	0,02
5,139 % éch. 25/01/2035		490	442	0,00
5,229 % éch. 25/08/2035 ^		4 700	4 090	0,01
5,289 % éch. 25/10/2037		17 319	13 524	0,02
5,319 % éch. 25/11/2035		74	74	0,00
5,339 % éch. 25/09/2037		1 757	1 440	0,00
5,364 % éch. 25/03/2036		3 410	2 870	0,01

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
5,389 % éch. 25/09/2037	$	4 276	$ 2 992	0,01
5,424 % éch. 25/05/2035		730	713	0,00
5,469 % éch. 25/07/2035		650	639	0,00
5,489 % éch. 25/09/2037		1 587	1 301	0,00
Southern Pacific Secured Asset Corp.				
4,789 % éch. 25/03/2028		68	63	0,00
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust				
3,546 % éch. 25/09/2037		3 310	1 160	0,00
3,837 % éch. 25/09/2037		7 776	6 784	0,01
4,509 % éch. 25/04/2037		831	595	0,00
4,689 % éch. 25/06/2037		1 851	1 099	0,00
4,689 % éch. 25/11/2037		9 160	5 281	0,01
4,739 % éch. 25/03/2037		1 589	957	0,00
5,364 % éch. 25/12/2035		1 144	1 112	0,00
St. Paul's CLO DAC				
2,298 % éch. 15/04/2033	€	1 200	1 243	0,00
START Ltd.				
4,089 % éch. 15/03/2044	$	13 150	11 239	0,02
Starwood Commercial Mortgage Trust				
5,520 % éch. 15/07/2038		18 314	17 949	0,03
5,840 % éch. 15/07/2038		14 830	14 372	0,03
6,040 % éch. 15/07/2038		5 930	5 774	0,01
Structured Asset Investment Loan Trust				
4,539 % éch. 25/07/2036		3 044	2 933	0,01
4,561 % éch. 25/07/2036		15 994	9 488	0,02
4,709 % éch. 25/05/2036		495	486	0,00
4,769 % éch. 25/03/2036		1 953	1 900	0,00
4,939 % éch. 25/09/2034		4 080	3 761	0,01
4,989 % éch. 25/04/2036		8 993	4 917	0,01
5,009 % éch. 25/01/2036		3 193	2 865	0,01
5,019 % éch. 25/11/2035		7 386	7 135	0,01
5,109 % éch. 25/04/2033		464	450	0,00
5,109 % éch. 25/04/2035		2 996	2 922	0,01
5,109 % éch. 25/09/2035		1 884	1 839	0,00
5,109 % éch. 25/01/2036		4 563	4 354	0,01
5,139 % éch. 25/07/2035		1 732	1 659	0,00
5,154 % éch. 25/08/2035		2 100	1 990	0,00
5,256 % éch. 25/09/2034		355	347	0,00
5,289 % éch. 25/05/2035		4 517	4 395	0,01
5,319 % éch. 25/01/2035		5 161	4 987	0,01
5,319 % éch. 25/06/2035		5 875	5 611	0,01
5,389 % éch. 25/09/2034		3 481	3 362	0,01
5,514 % éch. 25/07/2033		401	391	0,00
5,589 % éch. 25/12/2034		436	430	0,00
5,664 % éch. 25/12/2034		1 302	1 248	0,00
5,769 % éch. 25/04/2033		13	12	0,00
5,889 % éch. 25/11/2034		785	771	0,00
Structured Asset Securities Corp.				
4,132 % éch. 25/02/2035		1 867	1 802	0,00
5,529 % éch. 25/02/2035		584	550	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
4,519 % éch. 25/05/2036		3 491	3 366	0,01
4,539 % éch. 25/04/2036		3 985	3 933	0,01
4,544 % éch. 25/09/2036		9 807	6 200	0,01
4,549 % éch. 25/01/2037		8 537	8 130	0,01
4,559 % éch. 25/01/2037		1 103	1 087	0,00
4,569 % éch. 25/03/2036		1 700	1 630	0,00
4,597 % éch. 25/08/2034		115	111	0,00
4,609 % éch. 25/10/2037		19 988	13 429	0,02
4,619 % éch. 25/01/2037		15 351	9 306	0,02
4,619 % éch. 25/02/2037		12 258	11 654	0,02
4,619 % éch. 25/05/2047		7 208	6 935	0,01
4,639 % éch. 25/09/2036		340	340	0,00
4,659 % éch. 25/07/2036		161	161	0,00
4,679 % éch. 25/07/2036 ^		6 935	6 655	0,01
4,699 % éch. 25/08/2046		4 672	4 334	0,01
4,729 % éch. 25/12/2036		690	675	0,00
4,809 % éch. 25/02/2037		199	192	0,00
4,819 % éch. 25/03/2037		4 093	3 073	0,01
4,889 % éch. 25/11/2037		21 837	16 508	0,03
4,914 % éch. 25/07/2036		1 681	1 571	0,00
5,009 % éch. 25/12/2036		15 945	9 663	0,02
5,009 % éch. 25/02/2037		5 247	4 862	0,01
5,064 % éch. 25/04/2035		113	103	0,00
5,064 % éch. 25/06/2035		116	108	0,00
5,289 % éch. 25/08/2037		784	775	0,00
5,319 % éch. 25/05/2035		496	493	0,00
5,394 % éch. 25/11/2035		1 000	980	0,00
6,414 % éch. 25/07/2035		1 430	1 405	0,00
6,489 % éch. 25/11/2035		129	123	0,00
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				
5,214 % éch. 25/01/2035	$	566	$ 551	0,00
Structured Asset Securities Corp. Trust				
4,659 % éch. 25/05/2031		368	268	0,00
6,693 % éch. 25/05/2031		1 386	1 117	0,00
Symphony CLO Ltd.				
4,959 % éch. 15/04/2028		6 969	6 923	0,01
Taberna Preferred Funding Ltd.				
4,218 % éch. 05/07/2035		9 178	8 364	0,02
4,872 % éch. 05/05/2038		10 830	10 315	0,02
4,892 % éch. 05/12/2036		24 036	21 211	0,04
4,962 % éch. 05/11/2035		16 195	14 899	0,03
Terwin Mortgage Trust				
3,957 % éch. 25/08/2036		1 084	190	0,00
4,729 % éch. 25/07/2037		5 158	4 927	0,01
5,189 % éch. 25/09/2036		3 250	1 442	0,00
TICP CLO Ltd.				
5,083 % éch. 20/04/2028		9 568	9 540	0,02
Toro European CLO DAC				
2,118 % éch. 15/10/2030	€	1 499	1 567	0,00
2,298 % éch. 15/07/2030		3 866	4 055	0,01
Trapeza CDO Ltd.				
4,031 % éch. 06/04/2042	$	7 642	7 141	0,01
4,081 % éch. 06/07/2041		8 827	8 293	0,02
4,141 % éch. 06/07/2041		9 000	7 996	0,01
4,249 % éch. 10/10/2041		3 939	3 739	0,01
4,837 % éch. 09/11/2042		647	609	0,00
Tropic CDO Ltd.				
4,399 % éch. 15/07/2036		12 772	12 139	0,02
4,829 % éch. 15/04/2034		117	117	0,00
Truman Capital Mortgage Loan Trust				
4,869 % éch. 25/03/2036		1 294	1 117	0,00
TruPS Financials Note Securitization Ltd.				
5,900 % éch. 30/03/2039		31 918	30 689	0,05
6,316 % éch. 20/09/2039		8 647	8 172	0,01
Venture CLO Ltd.				
4,959 % éch. 15/04/2027		26 978	26 937	0,05
4,959 % éch. 15/07/2027		2 295	2 300	0,00
Vesey Park CLO DAC				
2,741 % éch. 16/11/2032	€	4 500	4 656	0,01
Voya Euro CLO DAC				
2,128 % éch. 15/10/2030		9 996	10 443	0,02
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				
4,519 % éch. 25/07/2047	$	5 968	3 652	0,01
4,539 % éch. 25/01/2037		19 054	16 331	0,03
4,559 % éch. 25/05/2037		3 449	2 823	0,01
4,579 % éch. 25/04/2037		25 259	9 779	0,02
4,614 % éch. 25/05/2037		835	761	0,00
4,639 % éch. 25/05/2037		3 305	2 718	0,01
4,639 % éch. 25/07/2047		5 727	3 509	0,01
4,749 % éch. 25/04/2037		799	311	0,00
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust				
4,689 % éch. 25/05/2036		875	673	0,00
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
4,619 % éch. 25/04/2037		2 436	2 354	0,00
4,689 % éch. 25/04/2037		1 000	680	0,00
4,709 % éch. 25/07/2036		3 200	3 006	0,01
4,734 % éch. 25/01/2037		3 605	3 452	0,01
4,809 % éch. 25/03/2037		1 734	1 685	0,00
4,899 % éch. 25/05/2036		3 877	3 744	0,01
6,114 % éch. 25/11/2035		3 475	3 405	0,01
6,489 % éch. 25/11/2035		2 472	2 359	0,00
6,789 % éch. 25/12/2034		817	802	0,00
6,939 % éch. 25/04/2035		751	732	0,00
8,139 % éch. 25/04/2035		1 592	1 588	0,00
Wells Fargo Home Equity Trust Mortgage Pass-Through Certificates				
5,129 % éch. 25/04/2034		220	214	0,00
			5 053 823	8,72
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement argentin				
0,500 % éch. 09/07/2030		337 885	85 341	0,15
1,000 % éch. 09/07/2029		18 219	4 874	0,01
1,500 % éch. 09/07/2035		278 448	66 218	0,11
1,500 % éch. 09/07/2046		8 050	2 079	0,00
3,500 % éch. 09/07/2041		170 054	48 763	0,08
3,875 % éch. 09/01/2038	$	115 791	$ 36 867	0,06
15,500 % éch. 17/10/2026	ARS	297 359	231	0,00
Obligation du Trésor argentin BONCER				
1,400 % éch. 25/03/2023		14 713 687	44 690	0,08
1,450 % éch. 13/08/2023		6 734 069	20 078	0,03
Obligation internationale du gouvernement australien				
1,750 % éch. 21/06/2051	AUD	204 800	80 487	0,14
Ville autonome de Buenos Aires				
72,479 % éch. 29/03/2024 (a)	ARS	1 161 075	3 637	0,01
72,986 % éch. 22/02/2028 (a)		766 034	2 187	0,00
Export-Credit Bank of Turkey				
8,250 % éch. 24/01/2024	$	13 400	13 608	0,02
Obligation internationale du gouvernement israélien				
3,800 % éch. 13/05/2060		161 411	126 959	0,22
4,500 % éch. 03/04/2120		4 400	3 882	0,01
Obligation internationale du gouvernement japonais				
0,100 % éch. 01/03/2023	¥	27 972 000	212 061	0,37
Banque de développement coréenne				
4,800 % éch. 10/06/2023	IDR	400 150 000	25 525	0,04
Letras de la Nacion Argentina con Ajuste por CER				
0,000 % éch. 19/05/2023 (e)	ARS	10 098 038	30 681	0,05
Obligation internationale du gouvernement péruvien				
5,350 % éch. 12/08/2040	PEN	10 588	2 078	0,00
5,400 % éch. 12/08/2034		121	25	0,00
5,940 % éch. 12/02/2029		258 492	62 228	0,11
6,150 % éch. 12/08/2032		27 732	6 409	0,01
6,350 % éch. 12/08/2028		106 177	26 493	0,05
6,900 % éch. 12/08/2037		7 647	1 804	0,00
6,950 % éch. 12/08/2031		31 232	7 738	0,01
8,200 % éch. 12/08/2026		289 399	79 479	0,14
Provincia de Buenos Aires				
72,913 % éch. 12/04/2025 (a)	ARS	3 331 617	9 231	0,02
Obligation internationale du gouvernement de la République hellénique				
3,500 % éch. 30/01/2023	€	4 304	4 601	0,01
3,750 % éch. 30/01/2028 (m)		4 618	4 931	0,01
3,900 % éch. 30/01/2033 (m)		9 948	10 152	0,02
4,000 % éch. 30/01/2037		6 211	6 221	0,01
4,200 % éch. 30/01/2042		3 488	3 710	0,01
Obligation internationale du gouvernement roumain				
1,750 % éch. 13/07/2030		56 300	41 986	0,07
2,000 % éch. 14/04/2033		27 192	18 666	0,03
2,125 % éch. 07/03/2028		25 500	22 782	0,04
2,750 % éch. 14/04/2041		34 000	20 462	0,04
2,875 % éch. 13/04/2042		68 000	40 816	0,07
3,750 % éch. 07/02/2034		29 500	23 574	0,04

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Obligation internationale du gouvernement russe				
0,000 % éch. 24/04/2024	RUB	18 336 201	$ 77 866	0,13
1,850 % éch. 20/11/2032 ^	€	2 800	867	0,00
4,250 % éch. 23/06/2027 ^	$	116 200	40 670	0,07
4,375 % éch. 21/03/2029 ^		6 000	1 800	0,00
4,750 % éch. 27/05/2026 ^		115 600	40 460	0,07
4,875 % éch. 16/09/2023 ^		7 400	6 105	0,01
5,100 % éch. 28/03/2035 ^		20 000	6 600	0,01
5,250 % éch. 23/06/2047 ^		345 400	127 798	0,22
5,625 % éch. 04/04/2042 ^		98 400	62 484	0,11
5,875 % éch. 16/09/2043 ^		26 600	15 883	0,03
7,150 % éch. 12/11/2025	RUB	20 520 713	87 143	0,15
7,500 % éch. 31/03/2030 ^	$	16 872	10 943	0,02
7,950 % éch. 07/10/2026	RUB	7 973 492	33 860	0,06
12,750 % éch. 24/06/2028 ^	$	41 736	32 632	0,06
Obligation internationale du gouvernement serbe				
3,125 % éch. 15/05/2027	€	9 758	8 985	0,02
Obligation internationale du gouvernement sud-africain				
10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	12 158 400	755 436	1,30
State Agency of Roads of Ukraine				
6,250 % éch. 24/06/2030	$	1 300	231	0,00
Obligation internationale du gouvernement turc				
4,250 % éch. 13/03/2025		259 500	243 255	0,42
5,250 % éch. 13/03/2030		155 000	125 163	0,22
6,125 % éch. 24/10/2028		28 900	25 894	0,04
7,625 % éch. 26/04/2029		94 000	88 932	0,15
Obligation internationale du gouvernement ukrainien				
4,375 % éch. 27/01/2032 ^	€	18 760	3 729	0,01
Bon du Trésor britannique				
1,250 % éch. 31/07/2051	£	14 980	9 744	0,02
1,500 % éch. 22/07/2047		6 910	5 079	0,01
1,750 % éch. 22/01/2049		13 820	10 650	0,02
3,250 % éch. 22/01/2044		12 410	13 273	0,02
3,500 % éch. 22/01/2045		11 860	13 148	0,02
Obligation internationale du gouvernement vénézuélien				
6,000 % éch. 09/12/2020 ^	$	9 289	650	0,00
7,000 % éch. 31/03/2038 ^		14 228	1 280	0,00
7,650 % éch. 21/04/2025 ^		28 167	2 465	0,00
7,750 % éch. 13/10/2019 ^		5 850	468	0,00
8,250 % éch. 13/10/2024 ^		35 331	3 091	0,01
9,000 % éch. 07/05/2023 ^		13 516	1 183	0,00
9,250 % éch. 15/09/2027 ^		34 519	3 279	0,01
9,250 % éch. 07/05/2028 ^		39 817	3 584	0,01
11,750 % éch. 21/10/2026 ^		3 990	369	0,00
12,750 % éch. 23/08/2022 ^		6 170	509	0,00
			3 067 062	5,29

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ACTIONS ORDINAIRES			
SERVICES DE COMMUNICATION			
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (d)	26 868 244	$ 28 212	0,05
iHeartMedia, Inc. « A » (d)	6 332 872	38 820	0,07
iHeartMedia, Inc. « B » (d)	4 913 662	27 109	0,04
		94 141	0,16
BIENS DE CONSOMMATION COURANTE			
Neiman Marcus Group Ltd. LLC (d)(l)	1 179 713	207 693	0,36
ÉNERGIE			
Constellation Oil Services Holding S.A. « B » (d)(l)	3 258 324	353	0,00
Noble Corp. PLC (d)	1 786 917	67 385	0,12
		67 738	0,12
ÉTATS FINANCIERS			
Cairo Mezz PLC (d)	3 408 327	323	0,00
Credit Suisse Group AG	2 843 931	8 486	0,02
Eurobank Ergasias Services and Holdings S.A. « A » (d)	40 899 918	45 930	0,08
Intelsat Emergence S.A. (d)(l)	4 649 159	111 580	0,19
Stearns Holdings LLC « B » (d)	1 114 539	0	0,00
Voyager Aviation Holdings LLC (d)	2 155	0	0,00
		166 319	0,29
INDUSTRIE			
Sierra Hamilton Holder LLC (d)(l)	2 210 032	0	0,00
Westmoreland Mining Holdings LLC (d)(l)	82 938	622	0,00
		622	0,00
		536 513	0,93
DROITS			
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05/12/2025	1 026 237	7 288	0,01
BONS DE SOUSCRIPTION			
Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10/06/2071 (l)	4	0	0,00
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31/12/2060	5 339	0	0,00
Intelsat Emergence S.A. - Exp. 17/02/2027	160 093	515	0,00
Windstream Holdings II, LLC - Exp. 21/09/2055	2 022 886	40 951	0,07
		41 466	0,07
TITRES DE PRÉFÉRENCE			
Nationwide Building Society 10,250 %	859 974	129 567	0,22
Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	12 927	3 469	0,01
		133 036	0,23
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT IMMOBILIER			
CBL & Associates Properties, Inc.	95 496	2 204	0,01
Uniti Group, Inc.	979 763	5 418	0,01
VICI Properties, Inc.	5 793 243	187 701	0,32
		195 323	0,34

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BILLETS À COURT TERME				
Corestate Capital Holding S.A.				
8,000 % éch. 15/04/2023 (l)	€	1 000	$ 1 068	0,00
Federal Home Loan Bank				
4,310 % éch. 03/01/2023	$	144 400	144 400	0,25
4,310 % éch. 04/01/2023		98 500	98 500	0,17
4,310 % éch. 20/01/2023		100 000	100 000	0,17
4,310 % éch. 25/01/2023		478 600	478 623	0,83
4,320 % éch. 06/01/2023		470 500	470 500	0,81
4,320 % éch. 24/01/2023		67 200	67 201	0,12
4,325 % éch. 06/02/2023		237 500	237 503	0,41
4,340 % éch. 10/02/2023		59 300	59 302	0,10
4,345 % éch. 23/02/2023		69 300	69 304	0,12
4,345 % éch. 06/03/2023		123 300	123 309	0,21
			1 849 710	3,19
BONS DU TRÉSOR ARGENTIN				
(105,064) % éch. 17/02/2023 (e)(f)	ARS	279 872	851	0,00
(5,093) % éch. 16/06/2023 (e)(f)		10 029 792	30 159	0,05
2,749 % éch. 18/09/2023 (e)(f)		7 801 290	23 092	0,04
			54 102	0,09
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS				
(0,249) % éch. 11/01/2023 (e)(f)	¥	847 000	6 420	0,01
(0,242) % éch. 23/01/2023 (e)(f)		6 905 000	52 338	0,09
(0,204) % éch. 06/01/2023 (e)(f)		9 090 000	68 893	0,12
(0,200) % éch. 06/03/2023 (e)(f)		153 000	1 160	0,00
(0,185) % éch. 13/03/2023 (e)(f)		14 368 000	108 930	0,19
(0,182) % éch. 20/03/2023 (e)(f)		17 278 000	130 997	0,23
(0,181) % éch. 13/03/2023 (e)(f)		2 662 000	20 182	0,03
(0,171) % éch. 20/03/2023 (e)(f)		20 099 000	152 385	0,26
(0,170) % éch. 06/01/2023 (e)(f)		10 300 000	78 064	0,13
(0,170) % éch. 16/01/2023 (e)(f)		18 180 000	137 793	0,24
(0,169) % éch. 11/01/2023 (e)(f)		14 540 000	110 201	0,19
(0,166) % éch. 13/03/2023 (e)(f)		13 365 000	101 326	0,18
(0,165) % éch. 20/02/2023 (e)(f)		25 380 000	192 400	0,33
(0,160) % éch. 30/01/2023 (e)(f)		330 000	2 501	0,00
(0,151) % éch. 13/03/2023 (e)(f)		9 257 000	70 181	0,12
(0,140) % éch. 06/03/2023 (e)(f)		424 000	3 214	0,01
(0,135) % éch. 06/03/2023 (e)(f)		19 830 000	150 335	0,26
(0,131) % éch. 06/03/2023 (e)(f)		56 310 000	426 897	0,74
(0,130) % éch. 20/02/2023 (e)(f)		121 200 000	918 789	1,58
			2 733 006	4,71

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
3,775 % éch. 12/01/2023 (e)(f)	$ 3 500	$ 3 497	0,01
Total instruments à court terme		4 640 315	8,00
Total des valeurs mobilières		**$ 67 246 471**	**115,99**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (i)	180 213 210	$ 1 793 842	3,09

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS INDICIELS COTÉS			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (i)	2 903 000	$ 287 586	0,50
Total Fonds d'investissement		**$ 2 081 428**	**3,59**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux directeur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Accords de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	en % de l'actif net
BOS	4,290 %	29/12/2022	05/01/2023	$ 500 000	Obligations du Trésor américain 2,750 % - 3,750 % échéance 15/11/2043 - 15/11/2047	$ (513 518)	$ 500 000	$ 500 417	0,86
DEU	4,230	30/12/2022	03/01/2023	116 100	Billet du Trésor américain 2,750 % échéance 15/11/2047	(118 445)	116 100	116 155	0,20
FICC	1,900	30/12/2022	03/01/2023	82 859	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 29/06/2023	(82 219)	82 859	82 868	0,14
					Billet du Trésor américain 1,250 % échéance 31/03/2028	(2 298)			
	4,280	30/12/2022	03/01/2023	1 954 800	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % - 0,250 % échéance 15/01/2025 - 15/04/2025	(323 152)	1 954 800	1 955 730	3,37
					Obligations du Trésor américain 0,250 % - 3,000 % échéance 15/05/2024 - 30/06/2025	(1 670 744)			
MBC	4,320	30/12/2022	03/01/2023	394 900	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 05/01/2023	(404 498)	394 900	395 090	0,68
	4,330	30/12/2022	06/01/2023	250 000	Obligations du Trésor américain 1,250 % - 3,500 % échéance 15/09/2025 - 31/08/2029	(257 998)	250 000	250 210	0,43
SGY	4,290	30/12/2022	03/01/2023	113 800	Obligations du Trésor américain 2,000 % - 3,250 % échéance 15/11/2041	(115 784)	113 800	113 854	0,20
SOG	4,380	16/12/2022	15/12/2024	9 239	Billet du Trésor américain 4,375 % échéance 23/11/2026	(9 894)	9 239	9 239	0,02
Total des contrats de mise en pension						**$ (3 498 550)**	**$ 3 421 698**	**$ 3 423 563**	**5,90**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2024	2 299	$ 10 628	0,02
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2025	1 188	3 260	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2026	1 289	3 303	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2024	1 498	5 102	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2025	1 206	3 143	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2024	1 990	7 941	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2025	1 087	2 899	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2026	1 206	3 048	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2024	1 390	4 125	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2025	986	2 524	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars	Court	03/2023	230	1 019	0,00
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	700	560	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	4 096	37 705	0,06
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	700	(3 579)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Long	03/2023	793	107	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	13 167	(2 055)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Court	03/2023	5 678	2 323	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Court	03/2023	6 395	6 621	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Long	03/2023	881	(933)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	6 106	3 559	0,01
				$ 91 300	0,16

(1) Option Future style (Style futur).

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Nbre de contrats	Prime	Juste valeur	en % de l'actif net
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	$ 98,000	15/12/2023	1 218	$ (359)	$ (105)	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	1 218	(479)	(3 694)	(0,01)
				$ (838)	$ (3 799)	(0,01)
Total des instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé					**$ 87 501**	**0,15**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
Airbus Finance BV	1,000 %	20/06/2028	€ 13 400	$ (380)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2023	$ 30 900	42	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2023	11 100	(123)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2024	69 900	116	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2025	9 500	(114)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	24 100	(367)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2026	6 600	(101)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2027	9 100	26	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20/12/2023	€ 25 600	45	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2023	$ 57 100	(114)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2023	20 400	65	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2024	5 570	129	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2025	19 600	207	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2025	11 700	122	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2026	3 200	(6)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2026	24 000	(136)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2027	30 200	831	0,00
Bombardier, Inc.	5,000	20/06/2024	4 600	223	0,00
Bombardier, Inc.	5,000	20/12/2024	4 900	378	0,00
Bombardier, Inc.	5,000	20/06/2025	200	23	0,00
Devon Energy Corp.	1,000	20/12/2026	6 500	17	0,00
Energy Transfer Operating LP	1,000	20/06/2026	2 900	73	0,00
Expedia Group, Inc.	1,000	20/12/2026	3 700	(56)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20/12/2024	12 100	(616)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20/06/2026	3 300	(183)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20/12/2026	4 400	(297)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20/06/2027	3 300	(136)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2023	3 400	(206)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2024	18 900	(14)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/12/2024	44 900	(543)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2025	24 800	(594)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/12/2025	25 300	464	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2026	8 200	(367)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/12/2026	6 600	(292)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2027	11 500	(423)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2023	109 900	6 305	0,01
General Electric Co.	1,000	20/12/2024	15 800	412	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	73 100	(119)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2026	23 900	(161)	0,00
General Motors Co.	5,000	20/12/2026	12 700	(1 046)	0,00
Hess Corp.	1,000	20/12/2026	3 500	24	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/06/2025	€ 15 000	512	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2025	26 300	1 331	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/06/2026	57 700	1 155	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2026	122 800	(3 560)	(0,01)
Rolls-Royce PLC	1,000	20/06/2027	28 200	(353)	0,00
Tesco PLC	1,000	20/06/2028	3 800	(91)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2026	$ 6 700	(145)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2026	32 300	(758)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2027	18 800	41	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2027	17 300	118	0,00
				$ 1 358	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE DE CRÉDIT SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION[2]

Indices/Tranches	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
Indice CDX.IG-35 à 5 ans	(1,000) %	20/12/2025	$ 107 200	$ 1 239	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE DE CRÉDIT SUR INDICES DE CRÉDIT – VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant du notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
Indice CDX.EM-29 à 5 ans	1,000 %	20/06/2023	$ 109 514	$ 2 225	0,00
Indice CDX.EM-30 à 5 ans	1,000	20/12/2023	378 250	4 759	0,01
Indice CDX.EM-31 à 5 ans	1,000	20/06/2024	99 588	3 391	0,01
Indice CDX.EM-32 à 5 ans	1,000	20/12/2024	71 910	2 727	0,00
Indice CDX.EM-34 à 5 ans	1,000	20/12/2025	218 224	1 323	0,00
Indice CDX.EM-35 à 5 ans	1,000	20/06/2026	1 380	0	0,00
Indice CDX.EM-36 à 5 ans	1,000	20/12/2026	743 636	27 808	0,05
Indice CDX.EM-37 à 5 ans	1,000	20/06/2027	6 958	226	0,00
Indice CDX.EM-38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	276 300	6 882	0,01
Indice CDX.HY-34 à 5 ans	5,000	20/06/2025	5 096	(330)	0,00
Indice CDX.HY-35 à 5 ans	5,000	20/12/2025	8 415	(493)	0,00
Indice CDX.HY-36 à 5 ans	5,000	20/06/2026	421 839	(25 132)	(0,04)
Indice CDX.HY-37 à 5 ans	5,000	20/12/2026	151 173	(3 596)	(0,01)
Indice CDX.HY-38 à 5 ans	5,000	20/06/2027	921 393	33 713	0,06
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000	20/12/2027	4 926 200	165 953	0,29
Indice CDX.IG-37 à 5 ans	1,000	20/12/2026	1 400	(15)	0,00
Indice CDX.IG-38 à 5 ans	1,000	20/06/2027	33 800	201	0,00
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000	20/12/2027	91 300	640	0,00
Indice iTraxx Asia Ex-Japan 38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	152 600	3 265	0,01
Indice iTraxx Crossover 38 à 5 ans	5,000	20/12/2027	€ 177 250	9 229	0,01
Indice iTraxx Europe Main 37 à 5 ans	1,000	20/06/2027	680 600	1 536	0,00
Indice iTraxx Europe Main 38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	234 250	3 663	0,01
				$ 237 975	0,41

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
À recevoir	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	0,500 %	16/09/2030	£ 254 700	$ 60 508	0,10
À payer	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	1,060	21/02/2052	14 400	(7 358)	(0,01)
À payer	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	1,096	14/02/2052	31 300	(15 743)	(0,03)
À payer	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	1,101	21/02/2052	14 400	(7 225)	(0,01)
À payer	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	1,175	28/02/2052	28 800	(13 955)	(0,02)
À recevoir[4]	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2033	1 007 500	15 156	0,03
À recevoir[4]	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053	26 200	228	0,00
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,000	20/09/2026	¥ 48 830 000	928	0,00
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,000	15/03/2029	344 670 000	105 478	0,19
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,020	20/09/2028	395 820 000	114 326	0,20
À payer	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,176	27/04/2027	22 270 000	(2 328)	0,00
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,400	15/06/2032	52 440 000	15 742	0,03
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,500	15/03/2042	27 980 000	18 143	0,03
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,711	27/04/2042	5 840 000	3 866	0,01
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2027	$ 386 590	34 876	0,06
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2029	495 770	55 097	0,10
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,250	15/06/2032	15 560	2 362	0,00
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,250	15/06/2032	635 270	(67 811)	(0,11)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,573	28/02/2027	96 300	(8 461)	(0,01)
À recevoir[4]	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,600	16/01/2026	943 900	22 522	0,04
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,618	09/02/2029	27 100	(3 004)	(0,01)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,620	18/04/2027	153 700	(13 558)	(0,02)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,650	08/02/2032	91 900	(13 380)	(0,02)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,730	24/02/2032	86 300	(12 084)	(0,02)
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2029	190 144	10 902	0,02
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	209 290	12 894	0,00
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	96 400	(8 281)	(0,01)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,765	16/03/2032	30 400	(4 185)	(0,01)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,770	14/02/2032	81 500	(11 084)	(0,02)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,783	22/04/2027	114 300	(9 221)	(0,02)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,788	03/05/2027	114 800	(9 329)	(0,02)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,817	05/04/2032	318 600	(42 843)	(0,06)

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,872 %	06/04/2032	$ 160 000	$ (20 742)	(0,04)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,928	25/03/2027	159 500	(11 680)	(0,02)
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2027	193 480	1 396	0,00
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2029	731 800	5 146	0,01
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2032	1 082 160	9 376	0,02
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,185	21/04/2029	96 000	(7 735)	(0,01)
À recevoir[4]	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,300	17/01/2026	678 900	16 037	0,03
À recevoir[4]	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,350	17/01/2025	1 204 900	17 726	0,03
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,370	21/06/2027	159 400	(9 050)	(0,02)
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,385	08/06/2032	26 800	2 273	0,00
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,430	30/09/2027	230 020	14 013	0,02
À recevoir[4]	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,450	20/12/2024	2 408 100	36 016	0,06
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,450	04/10/2027	221 690	13 305	0,02
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,451	08/06/2032	90 600	7 278	0,01
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,605	28/06/2027	158 600	(7 198)	(0,01)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,680	11/07/2032	27 300	(1 591)	0,00
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,690	11/07/2032	27 300	(1 563)	0,00
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,850	30/08/2027	137 400	(4 979)	(0,01)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,880	30/09/2027	657 200	(21 619)	(0,04)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,900	04/10/2027	633 400	(20 436)	(0,04)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,955	04/10/2027	141 800	(4 259)	(0,01)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	3,050	07/09/2027	69 900	(1 898)	0,00
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029	69 900	(2 076)	0,00
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	3,050	06/09/2032	104 600	(3 594)	(0,01)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	3,100	09/09/2029	70 000	(1 865)	0,00
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	3,350	14/12/2032	28 200	624	0,00
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	3,610	12/12/2032	56 700	45	0,00
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	3,750	13/12/2027	141 600	393	0,00
À payer	BRL-CDI à 1 an	5,830	02/01/2023	BRL 1 005 200	(3 411)	(0,01)
À payer	BRL-CDI à 1 an	5,836	02/01/2023	782 600	(2 613)	0,00
À payer	BRL-CDI à 1 an	5,855	02/01/2023	260 500	(843)	0,00
À payer	BRL-CDI à 1 an	11,140	02/01/2025	26 500	(164)	0,00
À payer	BRL-CDI à 1 an	11,160	02/01/2025	17 600	(108)	0,00
À payer	BRL-CDI à 1 an	11,220	04/01/2027	32 000	(236)	0,00
À payer	BRL-CDI à 1 an	11,245	04/01/2027	16 100	(116)	0,00
À payer	BRL-CDI à 1 an	11,260	04/01/2027	16 200	(116)	0,00
À payer	BRL-CDI à 1 an	11,350	02/01/2025	21 800	(117)	0,00
À payer	BRL-CDI à 1 an	11,700	04/01/2027	8 300	(39)	0,00
À payer	BRL-CDI à 1 an	11,715	04/01/2027	35 900	(167)	0,00
À payer	BRL-CDI à 1 an	11,870	04/01/2027	85 800	(327)	0,00
À payer	BRL-CDI à 1 an	12,000	02/01/2025	59 500	(170)	0,00
À payer	BRL-CDI à 1 an	12,080	02/01/2025	98 900	(252)	0,00
À payer	BRL-CDI à 1 an	12,140	02/01/2025	49 800	(116)	0,00
À payer	BRL-CDI à 1 an	12,145	02/01/2025	48 800	(113)	0,00
À payer	BRL-CDI à 1 an	12,160	02/01/2025	99 600	(224)	0,00
À recevoir	BRL-CDI à 1 an	12,670	02/01/2023	80 300	49	0,00
À recevoir	BRL-CDI à 1 an	12,690	02/01/2023	53 400	31	0,00
À recevoir	BRL-CDI à 1 an	12,740	02/01/2023	138 300	69	0,00
À recevoir	BRL-CDI à 1 an	12,750	02/01/2023	66 300	33	0,00
À recevoir	BRL-CDI à 1 an	12,760	02/01/2023	138 000	65	0,00
À recevoir	BRL-CDI à 1 an	12,900	02/01/2023	282 400	73	0,00
À recevoir	BRL-CDI à 1 an	12,930	02/01/2023	35 000	9	0,00
À recevoir	BRL-CDI à 1 an	12,939	02/01/2023	141 200	29	0,00

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel		Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
À recevoir	BRL-CDI à 1 an	12,946 %	02/01/2023	BRL	354 500	$ 74	0,00
À recevoir	BRL-CDI à 1 an	12,960	02/01/2023		282 400	51	0,00
À recevoir	BRL-CDI à 1 an	12,970	02/01/2023		464 100	86	0,00
À recevoir	Billet CAD-Bank à 3 mois	1,000	16/06/2047	CAD	2 600	705	0,00
À recevoir	Billet CAD-Bank à 3 mois	1,300	16/06/2047		2 500	651	0,00
À payer	Billet CAD-Bank à 3 mois	3,400	20/06/2029		6 300	(649)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,250	30/03/2023	$	492 700	5 572	0,01
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,500	16/06/2026		1 090 500	(99 208)	(0,17)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,500	16/06/2028		2 503 737	(288 896)	(0,50)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,550	15/01/2031		4 567 800	1 059 739	1,83
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,674	05/08/2030		62 900	13 938	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,678	29/07/2030		65 200	14 407	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,711	28/07/2030		69 000	15 113	0,03
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,715	27/07/2030		200 000	43 773	0,08
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,750	30/03/2031		963 600	204 050	0,35
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,750	16/06/2031		3 358 883	(438 769)	(0,76)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,800	15/01/2051		1 479 300	737 317	1,27
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,928	06/05/2026		150 100	16 438	0,03
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,975	17/06/2052		52 200	18 824	0,03
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,990	24/06/2052		75 000	26 694	0,05
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,000	26/01/2024		154 700	(6 928)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,000	16/12/2030		120 615	23 304	0,04
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,035	28/06/2052		25 900	8 991	0,02
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,144	04/11/2050		49 600	(20 482)	(0,04)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,150	30/03/2051		191 500	37 175	0,06
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,215	13/10/2050		83 500	(34 325)	(0,06)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,235	12/05/2028		75 400	10 460	0,02
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,250	15/12/2026		1 654 500	(196 391)	(0,34)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	16/06/2051		1 456 600	323 472	0,56
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,270	04/11/2023		7 957 500	(249 852)	(0,43)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,280	24/03/2028		423 400	(52 067)	(0,09)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,306	02/11/2051		48 000	16 099	0,03
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,317	16/12/2050		33 800	(12 813)	(0,02)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,350	20/01/2027		109 100	11 467	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,360	15/02/2027		387 430	40 573	0,07
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,360	20/07/2031		91 400	16 986	0,03
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,370	19/07/2031		61 300	11 348	0,02
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,380	04/01/2027		212 800	(21 532)	(0,04)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,405	07/09/2031		154 300	28 424	0,05
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,418	20/01/2027		71 900	(7 239)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,420	24/02/2027		269 100	27 450	0,05
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,425	18/01/2027		146 000	(14 522)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,443	18/01/2027		157 300	(15 523)	(0,03)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,450	17/02/2027		361 600	36 496	0,06
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,450	16/07/2031		137 000	24 750	0,04
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,485	13/01/2051		78 100	(28 270)	(0,05)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	15/12/2028		473 684	(71 590)	(0,12)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	12/01/2029		85 443	11 295	0,02
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	05/10/2031		89 100	(15 787)	(0,03)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,518	20/01/2029		43 100	(5 578)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,535	15/10/2031		88 600	(15 517)	(0,03)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,535	22/10/2031		59 100	(10 342)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,545	26/10/2031		58 900	(10 274)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,550	20/01/2027		485 100	(45 292)	(0,08)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,570	11/01/2027		121 400	(11 340)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,570	12/01/2027		76 200	(7 123)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,580	16/02/2027		150 400	(13 973)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,595	13/01/2051		82 600	(28 145)	(0,05)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,600	15/02/2027		1 549 700	(141 592)	(0,24)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	20/01/2029		60 000	(7 375)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	26/01/2029		72 000	(8 823)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,650	24/02/2027		897 000	(79 753)	(0,14)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,655	24/01/2032		72 000	(11 893)	(0,02)
À payer[4]	LIBOR USD à 3 mois	1,700	06/03/2024		344 400	(10 961)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,700	17/02/2027		1 446 200	(125 600)	(0,22)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,700	12/01/2029		310 700	(36 276)	(0,06)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,735	12/01/2032		57 800	(9 146)	(0,02)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,785	12/08/2051		76 100	25 033	0,04
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,815	24/01/2052		14 400	(4 368)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,867	26/01/2052		14 400	(4 214)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,945	23/06/2051		127 800	37 654	0,06
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,988	09/02/2032		22 000	2 969	0,01
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,000	18/02/2032		133 700	(17 832)	(0,03)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	15/12/2051		324 000	103 566	0,18
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,008	09/02/2032		36 700	4 970	0,01
À recevoir	ZAR-JIBAR à 3 mois	7,710	23/11/2025	ZAR	657 100	112	0,00
À payer	ZAR-JIBAR à 3 mois	7,750	19/09/2028		937 900	(1 782)	0,00
À payer	AUD-BBR-BBSW à 6 mois	2,750	17/06/2026	AUD	72 880	(2 001)	0,00
À payer	AUD-BBR-BBSW à 6 mois	3,000	21/03/2027		1 179 040	(54 398)	(0,09)
À payer	AUD-BBR-BBSW à 6 mois	3,250	17/12/2024		197 200	(8 404)	(0,01)
À payer	AUD-BBR-BBSW à 6 mois	3,500	17/06/2025		361 600	(19 931)	(0,03)

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel		Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
À payer	AUD-BBR-BBSW à 6 mois	4,250 %	17/12/2024	AUD 97 200	$	(8 151)	(0,01)
À payer	AUD-BBR-BBSW à 6 mois	4,750	18/06/2024	124 400		(12 608)	(0,02)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,150	18/03/2030	€ 907 700		199 536	0,34
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,150	17/06/2030	244 000		54 348	0,09
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,294	30/06/2026	6 200		785	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,329	30/12/2025	13 200		1 453	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,363	30/06/2025	20 500		1 973	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,395	30/12/2024	10 800		840	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,425	28/06/2024	24 600		1 514	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,453	29/12/2023	25 200		978	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,500	17/06/2050	126 900		58 030	0,10
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027	331 900		(34 037)	(0,06)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027	113 000		(11 336)	(0,02)
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	0,830	09/12/2052	876 100		25 922	0,04
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	243 100		(21 496)	(0,04)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	116 300		(10 275)	(0,02)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053	300		(32)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	21/09/2027	355 500		(23 537)	(0,04)
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	857 400		37 741	0,07
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	2,000	17/09/2024	149 000		21 681	0,04
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,000	21/09/2032	1 052 480		(125 280)	(0,22)
À payer	MXN-TIIE à 28 jours	7,165	06/09/2032	MXN 266 600		(1 402)	0,00
À payer	MXN-TIIE à 28 jours	7,360	21/08/2037	285 500		(1 217)	0,00
À recevoir	MXN-TIIE à 28 jours	7,380	14/08/2037	111 200		231	0,00
À payer	MXN-TIIE à 28 jours	7,480	18/06/2037	337 300		(1 878)	0,00
À payer	MXN-TIIE à 28 jours	7,495	14/01/2032	2 373 500		(9 287)	(0,02)
À payer	MXN-TIIE à 28 jours	7,498	15/01/2032	5 192 600		(20 259)	(0,03)
À payer	MXN-TIIE à 28 jours	7,498	19/06/2037	810 000		(4 473)	(0,01)
À recevoir	MXN-TIIE à 28 jours	8,103	04/01/2038	3 750 800		8 248	0,01
À payer	MXN-TIIE à 28 jours	8,280	28/11/2036	690 000		(5 051)	(0,01)
À payer	MXN-TIIE à 28 jours	8,310	28/11/2036	1 066 400		(7 958)	(0,01)
À recevoir	MXN-TIIE à 28 jours	8,410	31/03/2027	1 182 800		1 043	0,00
À recevoir	MXN-TIIE à 28 jours	8,660	04/04/2024	2 723 700		3 405	0,01
À recevoir	MXN-TIIE à 28 jours	8,675	03/04/2024	9 876 200		12 270	0,02
À recevoir	MXN-TIIE à 28 jours	8,701	31/03/2032	905 900		94	0,00
À recevoir	MXN-TIIE à 28 jours	8,730	06/04/2027	787 600		231	0,00
À recevoir	MXN-TIIE à 28 jours	8,732	30/03/2032	394 000		3	0,00
À recevoir	MXN-TIIE à 28 jours	8,750	05/04/2024	1 956 500		2 331	0,00
À payer	IPC Royaume-Uni	4,000	15/09/2031	£ 53 800		(7 686)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,020	15/10/2031	69 900		(9 501)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,055	15/09/2031	49 800		(7 022)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,066	15/09/2031	96 800		(11 926)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,140	15/10/2031	135 400		(16 468)	(0,03)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,250	15/11/2031	135 600		(13 052)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,400	15/10/2031	60 700		(6 090)	(0,01)
					$	973 632	1,68
Total des instruments financiers dérivés compensés					**$**	**1 214 204**	**2,09**

(1) Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(2) Si le Fonds est acheteur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds recevra (i) de la part du vendeur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et livrera l'obligation de référence ou les titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, de titres ou autres obligations livrables, égal au montant nominal du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(3) Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, tel que défini par les termes de ce contrat de swap précis.

(4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Voir note 2, Transactions sur titres et revenus sur investissements, dans les Notes relatives aux États financiers pour plus d'informations.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]		Coût	Juste valeur	en % de l'actif net
FAR	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 2 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,243 %	05/08/2024	291 100	$	3 930	$ 1 652	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 2 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,243	05/08/2024	291 100		3 930	7 230	0,01
GLM	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,110	26/07/2032	59 200		9 590	7 639	0,01
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,110	26/07/2032	85 900		13 916	17 711	0,03
MYC	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,053	20/07/2023	869 400		5 216	346	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,053	20/07/2023	869 400		5 216	12 868	0,02

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	en % de l'actif net
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,620 %	22/07/2024	869 400	$ 6 520	$ 3 070	0,01
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,620	22/07/2024	869 400	6 521	9 724	0,02
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 2 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,590	19/07/2024	616 200	8 473	4 518	0,01
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 2 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,590	19/07/2024	616 200	8 473	12 658	0,02
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,400	20/07/2027	68 100	8 986	6 585	0,01
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,400	20/07/2027	76 800	10 134	14 020	0,02
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,170	19/07/2032	68 100	10 801	8 948	0,02
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 30 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,170	19/07/2032	76 800	12 180	15 376	0,03
							$ 113 886	$ 122 345	0,21

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	en % de l'actif net
GST	Option de vente – Indice hors cote iTraxx Europe 37 à 5 ans	Vente	3,000 %	15/03/2023	77 600	$ (137)	$ (15)	0,00

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	en % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150 %	01/12/2023	158 300	$ (491)	$ (113)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	01/12/2023	158 300	(491)	(1 198)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	19/01/2023	50 900	(220)	(20)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,500	19/01/2023	50 900	(220)	(616)	0,00
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	11/04/2023	72 300	(73)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	11/04/2023	72 300	(221)	(1 124)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	28/04/2023	184 500	(320)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	28/04/2023	184 500	(320)	(2 618)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,150	09/01/2023	103 000	(363)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	09/01/2023	103 000	(363)	(620)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	23/01/2023	48 200	(121)	(30)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,770	23/01/2023	48 200	(121)	(246)	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	19/01/2023	50 900	(217)	(20)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,500	19/01/2023	50 900	(218)	(616)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	12/01/2023	77 400	(238)	(9)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	12/01/2023	77 400	(238)	(260)	0,00
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,690	02/04/2024	41 500	(326)	(123)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,690	02/04/2024	41 500	(326)	(521)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,150	09/01/2023	106 100	(374)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	09/01/2023	106 100	(374)	(639)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,765	25/07/2023	377 400	(2 359)	(168)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,765	25/07/2023	377 400	(2 359)	(6 614)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,468	25/07/2023	79 800	(1 907)	(345)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,468	25/07/2023	79 800	(1 907)	(4 180)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	96 700	(595)	(98)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	96 700	(595)	(1 328)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	77 900	(504)	(96)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	77 900	(504)	(996)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	77 500	(544)	(111)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	77 500	(544)	(915)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	77 500	(539)	(118)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	77 500	(539)	(885)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	77 500	(538)	(122)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	77 500	(538)	(864)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	77 700	(534)	(94)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	77 700	(534)	(1 017)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	77 400	(530)	(83)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	77 400	(530)	(1 086)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	77 800	(564)	(118)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,088	03/11/2023	77 800	(564)	(928)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,910	10/11/2023	78 600	(522)	(105)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,910	10/11/2023	78 600	(522)	(1 034)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	155 600	(564)	(108)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	155 600	(564)	(1 112)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	155 600	(543)	(98)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/11/2023	155 600	(543)	(1 206)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	159 200	(497)	(134)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	159 200	(497)	(1 100)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,697	02/04/2024	249 100	(1 954)	(744)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,697	02/04/2024	249 100	(1 954)	(3 115)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,721	08/04/2024	80 600	(608)	(250)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,721	08/04/2024	80 600	(608)	(986)	0,00

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	en % de l'actif net
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550 %	05/04/2023	197 900	$ (368)	$ 0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	05/04/2023	197 900	(368)	(3 055)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	11/04/2023	335 500	(646)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	11/04/2023	335 500	(646)	(5 215)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	24/04/2023	200 100	(216)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	24/04/2023	200 100	(565)	(2 822)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	26/04/2023	184 600	(325)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	26/04/2023	184 600	(325)	(2 615)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	15/05/2023	183 200	(322)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	15/05/2023	183 200	(322)	(2 909)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547	07/03/2023	127 800	(2 809)	(287)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	127 800	(2 809)	(8 048)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	168 300	(1 972)	(430)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	168 300	(2 324)	(5 506)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,230	23/01/2023	141 900	(351)	(70)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,730	23/01/2023	141 900	(351)	(842)	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	12/01/2023	77 400	(240)	(9)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	12/01/2023	77 400	(240)	(260)	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,050	19/07/2023	377 000	(2 262)	(206)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,050	19/07/2023	377 000	(2 262)	(5 689)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,052	20/07/2023	376 700	(2 317)	(213)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,052	20/07/2023	376 700	(2 317)	(5 640)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,700	19/07/2023	79 700	(1 857)	(458)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,700	19/07/2023	79 700	(1 857)	(3 492)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,675	20/07/2023	81 100	(1 885)	(455)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,675	20/07/2023	81 100	(1 885)	(3 621)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,993	11/10/2023	82 900	(560)	(110)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,993	11/10/2023	82 900	(560)	(1 122)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,550	19/07/2023	20 300	(1 464)	(465)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,550	19/07/2023	20 300	(1 464)	(2 710)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,537	20/07/2023	20 300	(1 478)	(458)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,537	20/07/2023	20 300	(1 478)	(2 748)	(0,01)
							$ (71 084)	$ (98 388)	(0,17)

OPTIONS À TAUX D'INTÉRÊT PLAFONNÉ

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	en % de l'actif net
FAR	Option d'achat - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote[2]	USD-LIBOR à 2 an	0,022 %	08/08/2026	291 100	$ (5 021)	$ (8 275)	(0,01)
	Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote[2]	USD-LIBOR à 2 an	0,022	08/08/2026	291 100	(5 021)	(2 736)	0,00
MYC	Achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an marché hors cote[2]	USD-LIBOR à 1 an	0,030	24/07/2024	869 400	(6 506)	(13 586)	(0,02)
	Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote[2]	USD-LIBOR à 1 an	0,030	24/07/2024	869 400	(6 506)	(1 186)	0,00
	Achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an marché hors cote[2]	USD-LIBOR à 1 an	0,026	23/07/2025	869 400	(7 615)	(10 774)	(0,02)
	Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote[2]	USD-LIBOR à 1 an	0,026	23/07/2025	869 400	(7 615)	(4 188)	(0,01)
	Option d'achat - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote[2]	USD-LIBOR à 2 an	0,026	23/07/2026	616 200	(10 898)	(15 199)	(0,03)
	Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote[2]	USD-LIBOR à 2 an	0,026	23/07/2026	616 200	(10 897)	(6 963)	(0,01)
						$ (60 079)	$ (62 907)	(0,10)

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	en % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	$ 101,89	05/01/2023	38 600	$ (115)	$ 0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	99,813	06/02/2023	11 900	(80)	(75)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	100,000	06/02/2023	9 000	(60)	(63)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	101,813	06/02/2023	11 900	(73)	(25)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	102,000	06/02/2023	9 000	(55)	(16)	0,00
JPM	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	97,000	06/03/2023	30 300	(260)	(466)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	97,156	06/03/2023	30 300	(260)	(491)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	99,000	06/03/2023	30 300	(223)	(77)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	99,156	06/03/2023	30 300	(220)	(68)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	98,766	06/03/2023	29 500	(249)	(403)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	100,766	06/03/2023	29 500	(212)	(97)	0,00
SAL	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	97,578	06/03/2023	15 600	(124)	(146)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	99,578	06/03/2023	15 600	(112)	(114)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	101,859	05/01/2023	48 400	(144)	0	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	102,250	05/01/2023	53 100	(158)	0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	99,750	06/02/2023	92 600	(661)	(561)	(0,01)
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	100,000	06/02/2023	27 200	(187)	(190)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	101,750	06/02/2023	92 600	(531)	(212)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	102,000	06/02/2023	27 200	(162)	(48)	0,00
					$ (3 886)	$ (3 052)	(0,01)

(1) Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

(2) Cet instrument sous-jacent a une date d'entrée en vigueur différée. Voir note 2, Transactions sur titres et revenus sur investissements, dans les Notes relatives aux États financiers pour plus d'informations.

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	en % de l'actif net
BOA	HSBC Holdings PLC	(1,000) %	20/06/2024	€ 1 300	$ 22	$ (28)	$ (6)	0,00
	UBS AG	(1,000)	20/06/2024	$ 19 300	1 254	(1 317)	(63)	0,00
BPS	UBS AG	(1,000)	20/06/2024	7 000	458	(481)	(23)	0,00
					$ 1 734	$ (1 826)	$ (92)	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[2]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	en % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000 %	20/12/2026	$ 5 500	$ (241)	$ 28	$ (213)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	60 500	(4 393)	2 961	(1 432)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2024	10 800	(998)	542	(456)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	23 000	(2 501)	1 126	(1 375)	0,00
BPS	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	14 700	(705)	(170)	(875)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	2 900	(259)	49	(210)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	17 900	(1 564)	1 140	(424)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	4 000	(287)	48	(239)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2025	1 300	(223)	122	(101)	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2023	8 750	(538)	558	20	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2024	7 070	(658)	360	(298)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	84 600	(11 485)	6 428	(5 057)	(0,01)
BYL	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	22 450	(1 502)	971	(531)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	15 260	(1 322)	410	(912)	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2024	168 400	(2 908)	2 418	(490)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2024	10 000	(102)	49	(53)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2024	29 600	116	(392)	(276)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2026	42 900	(1 989)	16	(1 973)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	10 600	(381)	(250)	(631)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2024	52 400	(847)	1 173	326	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2026	31 000	(203)	252	49	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2024	12 600	(1 154)	622	(532)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	4 700	(490)	209	(281)	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2024	13 700	(441)	436	(5)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2024	176 800	(2 751)	2 237	(514)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2023	32 600	(488)	452	(36)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	17 600	(687)	(361)	(1 048)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	8 200	(731)	136	(595)	0,00
	Equinix, Inc.	5,000	20/06/2027	9 000	1 258	(19)	1 239	0,00
	Obligation internationale du gouvernement indonésien	1,000	20/12/2027	24 600	(477)	486	9	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2023	17 650	(156)	217	61	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	60 300	(502)	932	430	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2027	38 200	(1 602)	1 100	(502)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	8 700	(449)	464	15	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2025	10 200	(565)	368	(197)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2026	4 800	(215)	29	(186)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2024	37 500	(3 786)	2 203	(1 583)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	58 600	(6 583)	3 080	(3 503)	(0,01)
HUS	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2023	30 100	(953)	1 020	67	0,00
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2024	255 100	(7 463)	7 364	(99)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2024	32 400	(94)	(78)	(172)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2023	261 150	(4 180)	5 563	1 383	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2026	2 200	(101)	0	(101)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	3 500	(135)	(73)	(208)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2026	33 200	(259)	311	52	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	37 600	(2 111)	2 177	66	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	2 200	(151)	99	(52)	0,00
MBC	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	6 200	(676)	305	(371)	0,00
MYC	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	21 700	(781)	(511)	(1 292)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	24 900	(2 220)	413	(1 807)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	47 400	(418)	756	338	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2025	5 300	(73)	97	24	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2026	56 100	(326)	414	88	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2026	44 400	68	(130)	(62)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2027	40 600	(137)	(161)	(298)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2027	82 700	(2 870)	1 784	(1 086)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2026	124 200	(5 441)	631	(4 810)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	12 500	(1 123)	827	(296)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2024	17 500	(1 945)	1 206	(739)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	4 600	(518)	243	(275)	0,00
					$ (84 716)	$ 52 687	$ (32 029)	(0,06)

SWAPS DE DÉFAILLANCE DE CRÉDIT SUR INDICES DE CRÉDIT – VENTE DE PROTECTION[2]

Contrepartie	Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	en % de l'actif net
BOA	Indice ABX.HE.AA.6-1	0,320 %	25/07/2045	$ 762	$ (263)	$ 204	$ (59)	0,00
	Indice ABX.HE.AAA.6-2	0,110	25/05/2046	33 582	(8 426)	8 094	(332)	0,00

Contrepartie	Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	en % de l'actif net
	Indice CMBX.NA.AS.6	1,000 %	11/05/2063	$ 232	$ (1)	$ 1	$ 0	0,00
BRC	Indice ABX.HE.AAA.6-2	0,110	25/05/2046	2 641	(661)	635	(26)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.13	0,500	16/12/2072	100 000	(1 840)	582	(1 258)	0,00
	Indice CMBX.NA.AS.6	1,000	11/05/2063	1 598	(54)	54	0	0,00
	Indice PRIMEX.ARM.2-AAA	4,580	25/12/2037	213	9	(6)	3	0,00
CBK	Indice CDX.HY-33 à 5 ans 35-100 %	5,000	20/12/2024	57 942	9 647	(4 415)	5 232	0,01
DUB	Indice CMBX.NA.AAA.10	0,500	17/11/2059	233 645	(4 705)	4 184	(521)	0,00
FBF	Indice CMBX.NA.AAA.11	0,500	18/11/2054	688 600	(4 427)	1 165	(3 262)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.12	0,500	17/08/2061	162 200	(1 133)	(162)	(1 295)	0,00
GST	Indice ABX.HE.AAA.6-2	0,110	25/05/2046	867	(205)	196	(9)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.10	0,500	17/11/2059	1 176 350	(15 149)	12 528	(2 621)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.11	0,500	18/11/2054	735 600	4 507	(7 992)	(3 485)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.12	0,500	17/08/2061	436 500	(12 201)	8 715	(3 486)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.13	0,500	16/12/2072	86 300	(1 494)	408	(1 086)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.15	0,500	18/11/2064	37 200	(315)	(564)	(879)	0,00
JPS	Indice CMBX.NA.AAA.10	0,500	17/11/2059	171 400	(2 957)	2 575	(382)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.11	0,500	18/11/2054	171 700	(1 351)	538	(813)	0,00
MEI	Indice CMBX.NA.AAA.12	0,500	17/08/2061	45 500	(336)	(27)	(363)	0,00
MYC	Indice CDX.HY-33 à 5 ans 35-100 %	5,000	20/12/2024	117 250	19 539	(8 951)	10 588	0,02
	Indice CMBX.NA.AAA.10	0,500	17/11/2059	66 700	(1 419)	1 270	(149)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.11	0,500	18/11/2054	364 800	(3 092)	1 364	(1 728)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.12	0,500	17/08/2061	923 900	(14 119)	6 741	(7 378)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.13	0,500	16/12/2072	379 100	507	(5 277)	(4 770)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.14	0,500	16/12/2072	171 300	(4 147)	1 190	(2 957)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.15	0,500	18/11/2064	74 400	(631)	(1 127)	(1 758)	0,00
	Indice CMBX.NA.AS.6	1,000	11/05/2063	139	(4)	4	0	0,00
SAL	Indice CMBX.NA.AAA.10	0,500	17/11/2059	810 495	(7 907)	6 101	(1 806)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.11	0,500	18/11/2054	152 400	(785)	63	(722)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.12	0,500	17/08/2061	1 386 500	(13 794)	2 722	(11 072)	(0,02)
	Indice CMBX.NA.AAA.13	0,500	16/12/2072	88 800	0	(1 117)	(1 117)	0,00
UAG	Indice CMBX.NA.AAA.10	0,500	17/11/2059	15 500	(445)	410	(35)	0,00
					$ (67 652)	$ 30 106	$ (37 546)	(0,06)

(1) Si le Fonds est acheteur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds recevra (i) de la part du vendeur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et livrera l'obligation de référence ou les titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, de titres ou autres obligations livrables, égal au montant nominal du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(2) Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(3) Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, tel que défini par les termes de ce contrat de swap précis.

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

Contrepartie	À payer/recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel	Date d'échéance	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	en % de l'actif net
BOA	À recevoir	Indice iBoxx USD Liquid High Yield	S/O	1,059 %	$ 2 100	20/03/2023	$ (3)	$ 83	$ 80	0,00
GST	À recevoir	Indice iBoxx USD Liquid High Yield	S/O	1,058	39 500	20/06/2023	(305)	(430)	(735)	0,00
							$ (308)	$ (347)	$ (655)	0,00

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement		Devise à livrer		Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	CHF	2 340	$	2 489	$ 0	$ (42)	$ (42)	0,00
	01/2023	€	1 409		1 486	0	(18)	(18)	0,00
	01/2023	£	650		782	0	0	0	0,00
	01/2023	¥	847 000		6 171	0	(254)	(254)	0,00
	01/2023	$	703 480	AUD	1 038 688	1 079	0	1 079	0,00
	01/2023		1 642	€	1 551	14	0	14	0,00
	01/2023		80 262	£	65 992	0	(869)	(869)	0,00
	01/2023		18 006	¥	2 374 400	2	(1)	1	0,00
	01/2023		32 020	KRW	41 798 908	1 204	0	1 204	0,00
	01/2023		4 564	PEN	17 525	22	0	22	0,00
	02/2023	¥	121 200 000	$	865 356	0	(58 976)	(58 976)	(0,10)
	02/2023	$	119 776	NOK	1 188 796	1 114	0	1 114	0,00
	02/2023	ZAR	47 553	$	2 653	0	(131)	(131)	0,00
	03/2023	¥	153 000		1 121	0	(48)	(48)	0,00
	03/2023	TWD	1 367 745		46 454	1 625	0	1 625	0,00
	03/2023	$	29	IDR	455 111	0	0	0	0,00
	03/2023	ZAR	244 817	$	13 865	0	(440)	(440)	0,00
	05/2023	PEN	68 686		17 573	0	(230)	(230)	0,00
BOM	01/2023	$	183 983	CAD	247 052	0	(1 644)	(1 644)	0,00
BPS	01/2023	AUD	6	$	4	0	0	0	0,00
	01/2023	BRL	337 287		64 085	202	0	202	0,00

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
	01/2023	CNH	3	$	0	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	ILS	430		126	3	0	3	0,00
	01/2023	$	22 511	€	21 114	32	0	32	0,00
	01/2023		9 566	£	7 926	0	(30)	(30)	0,00
	01/2023		17 796	ILS	57 408	0	(1 526)	(1 526)	0,00
	01/2023		548 117	KRW	714 634 849	19 918	0	19 918	0,03
	01/2023		238 331	NZD	372 508	0	(2 723)	(2 723)	(0,01)
	01/2023		56 289	ZAR	978 178	1 126	0	1 126	0,00
	02/2023		50 554	IDR	794 962 417	851	0	851	0,00
	02/2023	ZAR	678 005	$	37 771	0	(1 940)	(1 940)	0,00
	03/2023	INR	88 429		1 066	3	0	3	0,00
	03/2023	TWD	53 559		1 776	21	0	21	0,00
	03/2023	$	36 192	CLP	34 512 636	3 892	0	3 892	0,01
	03/2023		16 350	MXN	329 523	327	0	327	0,00
	03/2023		9 182	PEN	35 404	47	0	47	0,00
	04/2023		48 467	CLP	43 472 673	1 848	0	1 848	0,00
	09/2023		528	ZAR	9 322	9	0	9	0,00
BRC	01/2023	CNH	9 049	$	1 298	0	(12)	(12)	0,00
	01/2023	€	2 060		2 190	0	(10)	(10)	0,00
	01/2023	¥	10 300 000		73 011	0	(5 062)	(5 062)	(0,01)
	01/2023	PEN	126 465		32 367	0	(766)	(766)	0,00
	01/2023	$	5 499	€	5 140	0	(11)	(11)	0,00
	01/2023		26 021	£	21 323	0	(368)	(368)	0,00
	01/2023		12 354	PEN	47 591	98	0	98	0,00
	01/2023		434	SGD	585	2	0	2	0,00
	02/2023		20 662	PEN	79 880	212	0	212	0,00
	03/2023	¥	37 377 000	$	278 273	0	(7 870)	(7 870)	(0,01)
	03/2023	$	48	IDR	749 896	1	0	1	0,00
CBK	01/2023	AUD	17 995	$	12 094	0	(112)	(112)	0,00
	01/2023	CHF	21 764		23 042	0	(497)	(497)	0,00
	01/2023	CLP	11 560 210		13 291	0	(259)	(259)	0,00
	01/2023	€	2 928 969		3 036 743	0	(90 535)	(90 535)	(0,16)
	01/2023	ILS	87 391		27 696	2 928	0	2 928	0,01
	01/2023	PEN	115 522		28 784	0	(1 443)	(1 443)	0,00
	01/2023	$	84 132	AUD	124 065	49	(25)	24	0,00
	01/2023		45 319	€	42 622	189	0	189	0,00
	01/2023		8 549	¥	1 137 000	74	0	74	0,00
	01/2023		22 156	NZD	34 653	0	(238)	(238)	0,00
	01/2023		479	PEN	1 841	4	0	4	0,00
	01/2023		10 897	ZAR	190 919	304	0	304	0,00
	02/2023	COP	20 000 000	$	4 118	37	0	37	0,00
	02/2023	PEN	4 743		1 193	0	(47)	(47)	0,00
	02/2023	ZAR	19 518		1 120	0	(22)	(22)	0,00
	03/2023	PEN	19 383		5 017	0	(32)	(32)	0,00
	03/2023	$	44 896	MXN	882 630	69	(291)	(222)	0,00
	03/2023		14 075	PEN	56 583	681	0	681	0,00
	04/2023		13 291	CLP	11 734 992	263	0	263	0,00
	04/2023		55 617	PEN	222 288	2 174	0	2 174	0,00
	04/2023	ZAR	700 958	$	37 854	0	(3 000)	(3 000)	(0,01)
	05/2023	$	39 911	MXN	806 724	541	0	541	0,00
CLY	03/2023		13 564	PEN	52 180	29	0	29	0,00
DUB	01/2023	¥	41 810 000	$	296 709	0	(20 485)	(20 485)	(0,04)
	01/2023	$	8 145	DKK	57 791	153	0	153	0,00
	02/2023	MXN	996 199	$	50 000	0	(680)	(680)	0,00
	02/2023	ZAR	64 861		3 884	85	0	85	0,00
GLM	01/2023	BRL	3 227 418		620 508	9 310	(84)	9 226	0,02
	01/2023	CNH	9 392		1 350	0	(9)	(9)	0,00
	01/2023	$	289 956	BRL	1 564 705	6 403	0	6 403	0,01
	01/2023		11 672	CLP	11 500 000	1 808	0	1 808	0,00
	01/2023		3 633	HKD	28 283	0	(8)	(8)	0,00
	01/2023		9 241	ILS	29 712	0	(820)	(820)	0,00
	01/2023	ZAR	48 579	$	2 717	0	(134)	(134)	0,00
	02/2023	$	34 476	BRL	180 119	0	(546)	(546)	0,00
	03/2023	MXN	761 736	$	38 322	0	(274)	(274)	0,00
	03/2023	$	6 501	CLP	5 759 159	196	0	196	0,00
	03/2023		602 098	MXN	12 360 807	23 486	0	23 486	0,04
	04/2023	MXN	26 017	$	1 293	0	(16)	(16)	0,00
	04/2023	$	575 565	BRL	3 047 299	85	(8 399)	(8 314)	(0,01)
	05/2023	PEN	17 723	$	4 379	0	(221)	(221)	0,00
	05/2023	ZAR	113 996		6 821	193	0	193	0,00
JPM	01/2023	€	17 225		17 911	0	(480)	(480)	0,00
	01/2023	$	375 863	BRL	2 000 000	2 943	0	2 943	0,01
	01/2023		1 235	£	1 022	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023		4 635	ZAR	81 283	136	0	136	0,00
	02/2023	NOK	8 470	$	856	0	(5)	(5)	0,00
	02/2023	TWD	1 583 060		52 143	429	0	429	0,00
	02/2023	$	371 257	BRL	2 000 000	5 485	0	5 485	0,01
	02/2023		87 141	IDR	1 373 078 956	1 647	0	1 647	0,00
	02/2023		36 000	MXN	736 421	1 560	0	1 560	0,00
	03/2023	MXN	784 858	$	38 174	15	(1 563)	(1 548)	0,00
	03/2023	$	93 592	IDR	1 464 908 549	1 102	0	1 102	0,00
	03/2023		1 810	MXN	35 902	7	0	7	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
MBC	01/2023	AUD	10 637	$	7 111	$ 0	$ (105)	$ (105)	0,00
	01/2023	CAD	411		306	3	0	3	0,00
	01/2023	€	21 548		22 757	0	(250)	(250)	0,00
	01/2023	£	2 850 877		3 415 812	697	(14 749)	(14 052)	(0,02)
	01/2023	PEN	1 396		360	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	$	67 857	AUD	99 072	88	(743)	(655)	0,00
	01/2023		7 382	DKK	52 260	122	0	122	0,00
	01/2023		22 446	€	21 138	124	0	124	0,00
	01/2023		22 677	£	18 599	0	(301)	(301)	0,00
	01/2023		15 079	HKD	117 390	0	(33)	(33)	0,00
	01/2023		270 266	¥	36 876 671	9 533	(125)	9 408	0,02
	01/2023		1 174	NZD	1 847	0	(6)	(6)	0,00
	01/2023		461	ZAR	7 892	2	0	2	0,00
	01/2023	ZAR	2 441 468	$	140 910	0	(2 382)	(2 382)	0,00
	02/2023	IDR	11 967 146		758	0	(16)	(16)	0,00
	02/2023	$	479	MXN	9 865	24	0	24	0,00
	03/2023	TWD	1 918 464	$	65 194	2 314	0	2 314	0,00
	03/2023	$	56 799	IDR	889 123 953	676	0	676	0,00
	03/2023		2 881	MXN	57 631	36	0	36	0,00
	05/2023	CNH	5 907	$	880	18	0	18	0,00
	09/2023	$	1 492	ZAR	26 404	28	0	28	0,00
	09/2023	ZAR	2 863 258	$	158 281	0	(6 604)	(6 604)	(0,01)
MYI	01/2023	AUD	298		201	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	CHF	3 503		3 794	7	0	7	0,00
	01/2023	€	12 102		12 883	0	(32)	(32)	0,00
	01/2023	£	21 338		26 085	414	0	414	0,00
	01/2023	HKD	700		90	0	0	0	0,00
	01/2023	¥	10 450		78	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	SGD	7 203		5 363	0	(7)	(7)	0,00
	01/2023	$	174 459	AUD	259 787	1 758	0	1 758	0,00
	01/2023		574	€	537	0	0	0	0,00
	01/2023		2 735	£	2 268	0	(6)	(6)	0,00
	01/2023		15	HKD	117	0	0	0	0,00
	01/2023		960 905	¥	131 737 985	38 204	0	38 204	0,07
	01/2023		1 035	ZAR	17 867	14	0	14	0,00
	02/2023	TWD	2 926 743	$	96 000	391	0	391	0,00
	02/2023	ZAR	1 272 524		69 555	0	(4 996)	(4 996)	(0,01)
	03/2023	TWD	1 744 706		59 243	2 058	0	2 058	0,00
	03/2023	$	79 880	IDR	1 252 759 749	1 101	0	1 101	0,00
	03/2023		639	MXN	12 662	2	0	2	0,00
RBC	01/2023	CAD	815 648	$	597 100	0	(4 897)	(4 897)	(0,01)
	01/2023	€	5		5	0	0	0	0,00
	01/2023	$	2 006	AUD	2 992	23	0	23	0,00
	01/2023		1 766	£	1 462	0	(7)	(7)	0,00
	01/2023		368	ZAR	6 487	13	0	13	0,00
	02/2023	MXN	3 597 357	$	181 448	0	(2 027)	(2 027)	0,00
	02/2023	$	181 671	NOK	1 812 645	2 656	0	2 656	0,00
	03/2023		128 178	MXN	2 563 736	1 722	0	1 722	0,00
RYL	01/2023	€	555	$	586	0	(7)	(7)	0,00
	01/2023	¥	7 235 000		52 874	0	(2 092)	(2 092)	0,00
	01/2023	$	5 163	¥	690 400	73	0	73	0,00
	02/2023	¥	25 380 000	$	185 131	0	(8 428)	(8 428)	(0,01)
	02/2023	SEK	15 910		1 545	14	0	14	0,00
SCX	01/2023	$	1 956	AUD	2 903	13	0	13	0,00
	01/2023		160 423	CAD	215 519	0	(1 357)	(1 357)	0,00
	01/2023		3 329	€	3 127	10	0	10	0,00
	01/2023		13 540	£	10 936	0	(383)	(383)	0,00
	01/2023		1 771	¥	240 000	49	0	49	0,00
	01/2023		24 618	PEN	94 512	159	0	159	0,00
	02/2023		8 284	CLP	7 429 737	397	0	397	0,00
	02/2023		91 779	IDR	1 444 786 639	1 644	0	1 644	0,00
	03/2023	CLP	266 478	$	299	0	(11)	(11)	0,00
	03/2023	$	9 206	CLP	8 218 119	350	0	350	0,00
	03/2023		649	MXN	12 889	4	0	4	0,00
	03/2023		9 390	PEN	36 132	29	0	29	0,00
	04/2023	ZAR	2 566 031	$	139 587	0	(9 966)	(9 966)	(0,02)
	09/2023		2 911 476		165 943	0	(1 628)	(1 628)	0,00
SOG	01/2023	$	506	ZAR	8 776	9	0	9	0,00
SSB	01/2023	PEN	1 990	$	516	0	(6)	(6)	0,00
	01/2023	$	515	PEN	1 990	6	0	6	0,00
TOR	01/2023		9 406	AUD	13 936	47	0	47	0,00
	01/2023		223 294	CAD	300 172	0	(1 749)	(1 749)	0,00
	01/2023		29 423	NZD	45 613	0	(573)	(573)	0,00
	01/2023		3 646	SGD	4 938	37	0	37	0,00
	01/2023		13 308	ZAR	231 921	307	0	307	0,00
	01/2023	ZAR	106 003	$	5 757	0	(462)	(462)	0,00
	03/2023	$	31 317	CLP	28 219 523	1 498	0	1 498	0,00
UAG	01/2023		24 446	£	19 797	0	(628)	(628)	0,00
	01/2023		357	ZAR	6 238	10	0	10	0,00
	01/2023	ZAR	679 412	$	37 931	0	(1 952)	(1 952)	0,00
	02/2023	$	134 914	IDR	2 141 407 014	3 567	0	3 567	0,01
	03/2023	¥	144 201 986	$	1 061 929	0	(39 962)	(39 962)	(0,07)
						$ 166 288	$ (319 698)	$ (153 410)	(0,26)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en AUD (couverte) de Capitalisation, Investisseurs en AUD (couverte) de Distribution, Administrations en AUD (couverte) de Distribution, E en AUD (couverte) de Distribution et Z en AUD (couverte) de Distribution II :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
AZD	01/2023	$	406 226	AUD	603 039	$ 2 825	$ 0	$ 2 825	0,01
BOA	01/2023	AUD	20 375	$	13 790	0	(30)	(30)	0,00
	01/2023	$	696	AUD	1 032	3	0	3	0,00
CBK	01/2023	AUD	523	$	353	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$	19 296	AUD	28 339	25	(98)	(73)	0,00
MBC	01/2023		196 775		292 639	1 881	(154)	1 727	0,00
MYI	01/2023		477 013		710 318	4 808	0	4 808	0,01
RBC	01/2023	AUD	39	$	26	0	0	0	0,00
	01/2023	$	77 512	AUD	115 600	902	0	902	0,00
SCX	01/2023	AUD	4 334	$	2 947	7	0	7	0,00
TOR	01/2023	$	430 689	AUD	638 107	2 149	0	2 149	0,00
						$ 12 600	$ (284)	$ 12 316	0,02

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en BRL (couverte) Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	$	1 987	BRL	10 347	$ 0	$ (27)	$ (27)	0,00
BPS	01/2023	BRL	36 777	$	6 793	0	(173)	(173)	0,00
	01/2023	$	45 741	BRL	248 057	1 271	(29)	1 242	0,00
	02/2023	BRL	911	$	171	0	0	0	0,00
BSH	01/2023		10 583		2 013	9	0	9	0,00
	01/2023	$	1 843	BRL	9 605	0	(24)	(24)	0,00
CBK	01/2023	BRL	975 203	$	184 570	744	(881)	(137)	0,00
	01/2023	$	96 713	BRL	532 962	4 231	0	4 231	0,01
	02/2023		183 434		975 203	940	(674)	266	0,00
GLM	01/2023	BRL	500 010	$	94 471	35	(268)	(233)	0,00
	01/2023	$	93 312	BRL	512 917	3 836	0	3 836	0,01
	02/2023	BRL	4 791	$	904	2	0	2	0,00
	02/2023	$	92 407	BRL	492 247	336	(18)	318	0,00
JPM	01/2023	BRL	52 431	$	9 866	38	(102)	(64)	0,00
	01/2023	$	47 694	BRL	261 116	1 774	(12)	1 762	0,00
	02/2023	BRL	6 428	$	1 227	16	0	16	0,00
	02/2023	$	1 296	BRL	6 761	0	(22)	(22)	0,00
						$ 13 232	$ (2 230)	$ 11 002	0,02

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CAD (couverte) de Capitalisation et Institutions en CAD (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	$	8 672	CAD	11 726	$ 0	$ (18)	$ (18)	0,00
BOM	01/2023		22 698		30 479	0	(203)	(203)	0,00
CBK	01/2023	CAD	1 210	$	895	2	0	2	0,00
	01/2023	$	142	CAD	194	1	0	1	0,00
MBC	01/2023	CAD	1 367	$	1 003	0	(6)	(6)	0,00
	01/2023	$	55 522	CAD	75 121	0	(78)	(78)	0,00
MYI	01/2023	CAD	609	$	449	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	616	CAD	834	0	(1)	(1)	0,00
RBC	01/2023	CAD	111	$	81	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	$	14 198	CAD	19 075	0	(120)	(120)	0,00
TOR	01/2023		49 958		67 158	0	(391)	(391)	0,00
						$ 3	$ (818)	$ (815)	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de Capitalisation, Institutions en CHF (couverte) de Distribution, E en CHF (couverte) de Capitalisation et E en CHF (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	$	227 990	CHF	215 608	$ 5 199	$ 0	$ 5 199	0,01
BRC	01/2023	CHF	486	$	524	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	$	279	CHF	259	1	0	1	0,00
CBK	01/2023		395 597		373 693	8 568	0	8 568	0,01
MBC	01/2023	CHF	245	$	264	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	3 894	CHF	3 598	5	(8)	(3)	0,00
MYI	01/2023	CHF	1 148	$	1 221	0	(21)	(21)	0,00
	01/2023	$	1 563	CHF	1 455	11	0	11	0,00
SCX	01/2023	CHF	7 096	$	7 655	0	(20)	(20)	0,00
	01/2023	$	3 797	CHF	3 521	11	0	11	0,00
UAG	01/2023		74		68	0	0	0	0,00
						$ 13 795	$ (53)	$ 13 742	0,02

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Institutions en EUR (couverte) de distribution II, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Investisseurs en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de distribution A, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, Administrations en EUR (couverte) de distribution, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution, E en EUR (couverte) de distribution II, E en EUR (couverte) de distribution II Q, G Détail en EUR (couverte) de distribution, R en EUR (couverte) de distribution, T en EUR (couverte) de capitalisation et T en EUR (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	$	8 975	€	8 510	$ 111	$ 0	$ 111	0,00
BPS	01/2023		113 529		107 183	911	0	911	0,00
CBK	01/2023	€	141 354	$	149 111	0	(1 815)	(1 815)	0,00
	01/2023	$	4 824 842	€	4 650 972	141 028	0	141 028	0,24
JPM	01/2023		14 779		14 213	396	0	396	0,00
MBC	01/2023	€	51 949	$	55 271	3	(198)	(195)	0,00
	01/2023	$	5 559 995	€	5 304 027	103 144	0	103 144	0,18
SCX	01/2023		5 077 201		4 877 939	131 001	0	131 001	0,23
						$ 376 594	$ (2 013)	$ 374 581	0,65

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de Capitalisation, Institutions en GBP (couverte) de Distribution, Investisseurs en GBP (couverte) de Distribution, Administrations en GBP (couverte) de Distribution, E en GBP (couverte) de Distribution et R en GBP (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	£	5 744	$	7 014	$ 103	$ 0	$ 103	0,00
	01/2023	$	2 312	£	1 893	0	(34)	(34)	0,00
BPS	01/2023	£	120	$	145	1	0	1	0,00
	01/2023	$	525	£	436	0	(1)	(1)	0,00
BRC	01/2023	£	4 426	$	5 330	5	0	5	0,00
	01/2023	$	154	£	128	0	0	0	0,00
JPM	01/2023		410 289		339 777	0	(1 507)	(1 507)	0,00
MBC	01/2023	£	7 729	$	9 428	129	0	129	0,00
	01/2023	$	406 532	£	339 000	1 667	(351)	1 316	0,00
MYI	01/2023	£	390	$	476	7	0	7	0,00
	01/2023	$	11 138	£	9 062	0	(236)	(236)	0,00
TOR	01/2023		406 990		338 513	272	0	272	0,00
UAG	01/2023	£	35 618	$	44 062	1 210	0	1 210	0,00
						$ 3 394	$ (2 129)	$ 1 265	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories E en JPY (couverte) de capitalisation et E en JPY (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	$	2 423	¥	331 869	$ 93	$ 0	$ 93	0,00
BRC	01/2023		37		4 883	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	¥	352 633	$	2 581	0	(94)	(94)	0,00
MBC	01/2023		27 885		204	0	(7)	(7)	0,00
	01/2023	$	3 757	¥	514 835	147	0	147	0,00
MYI	01/2023	¥	970	$	7	0	0	0	0,00
	01/2023	$	15 484	¥	2 123 289	620	0	620	0,00
RYL	01/2023		78		10 450	1	0	1	0,00
SCX	01/2023		10 616		1 466 355	505	0	505	0,00
						$ 1 366	$ (101)	$ 1 265	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) Capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BRC	01/2023	$	62 168	NOK	618 606	$ 645	$ 0	$ 645	0,00
CBK	01/2023		68 745		681 402	443	0	443	0,00
DUB	01/2023		1 462		14 410	2	0	2	0,00
MBC	01/2023	NOK	3 749	$	376	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	$	11 925	NOK	116 609	0	(84)	(84)	0,00
MYI	01/2023	NOK	13 779	$	1 379	0	(20)	(20)	0,00
	01/2023	$	2 955	NOK	29 687	59	0	59	0,00
RYL	01/2023		11		105	0	0	0	0,00
SCX	01/2023		71 231		706 325	518	(30)	488	0,00
						$ 1 667	$ (139)	$ 1 528	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change suivants étaient en cours au titre des Catégories Investisseurs en RMB (couverte) de Capitalisation et E en RMB (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BRC	01/2023	$	24 471	CNH	172 864	$ 527	$ 0	$ 527	0,00
GLM	01/2023		2 147		15 171	47	0	47	0,00
MBC	01/2023	CNH	4 572	$	654	0	(7)	(7)	0,00
	01/2023	$	26 087	CNH	186 645	904	0	904	0,00
SOG	01/2023		110		766	1	0	1	0,00
UAG	01/2023		26 426		186 846	594	0	594	0,00
						$ 2 073	$ (7)	$ 2 066	0,00

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de Capitalisation, Institutions en SGD (couverte) de Distribution, Investisseurs en SGD (couverte) de Capitalisation, Investisseurs en SGD (couverte) de Distribution, Administrations en SGD (couverte) de Distribution et E en SGD (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
AZD	01/2023	SGD	23 369	$	17 204	$ 0	$ (224)	$ (224)	0,00
BOA	01/2023	$	876 684	SGD	1 202 963	20 386	0	20 386	0,04
BPS	01/2023		864 698		1 186 444	20 052	0	20 052	0,04
BRC	01/2023		10 490		14 291	167	0	167	0,00
GLM	01/2023		66 532		90 625	1 049	0	1 049	0,00
MBC	01/2023	SGD	17 225	$	12 847	2	0	2	0,00
	01/2023	$	909 908	SGD	1 243 941	17 719	0	17 719	0,03
RBC	01/2023		3 397		4 585	23	0	23	0,00
RYL	01/2023		705		956	8	0	8	0,00
SCX	01/2023		76 914		104 416	951	0	951	0,00
UAG	01/2023	SGD	7 874	$	5 760	0	(112)	(112)	0,00
	01/2023	$	30 079	SGD	40 774	327	0	327	0,00
						$ 60 684	$ (336)	$ 60 348	0,11
Total des instruments financiers dérivés hors cote								**$ 211 549**	**0,37**

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Fannie Mae, TBA			
3,500 % éch. 01/02/2049 (k)	$ 775 593	$ (704 716)	(1,22)
Ginnie Mae, TBA			
2,500 % éch. 01/01/2053	31 500	(27 305)	(0,05)
2,500 % éch. 01/02/2053	2 400	(2 082)	0,00
Total des titres vendus à découvert		**$ (734 103)**	**(1,27)**
Total des investissements		**$ 73 528 748**	**126,82**
Autres actifs et passifs courants		**$ (15 548 421)**	**(26,82)**
Actifs nets		**$ 57 980 327**	**100,00**

ANNEXES À L'ÉTAT DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

µ La totalité ou une partie de ce montant représente des engagements de prêt non financés. Le taux d'intérêt pour la partie non financée sera déterminé au moment du financement. Pour de plus amples informations sur les engagements de prêts non financés, voir la Note 4, Titres et autres investissements, des Notes relatives aux États financiers.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est une obligation Interest Only (« IO ») ou une obligation zéro-coupon (IO Strip).

(b) Titre à principal uniquement.

(c) Titre à rémunération en nature.

(d) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(e) Titre à coupon zéro.

(f) Le coupon représente un rendement à échéance.

(g) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

(h) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(i) Affilié au Fonds.

(J) Titre convertible conditionnel.

(k) Le titre vendu à découvert au 31 décembre 2022 est couvert par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.

(l) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,91 %) :

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	en % de l'actif net
ADLER Group S.A. 12,500 % échéance 31/07/2025	22/12/2022	$ 1 001	$ 1 001	0,00
Chester A PLC 0,000 % échéance 17/03/2046	18/04/2019	12 756	13 718	0,02
Chester A PLC 4,225 % échéance 17/03/2046	18/04/2019	78 855	72 528	0,13
Chester A PLC 4,675 % échéance 17/03/2046	18/04/2019	19 159	17 546	0,03
Chester A PLC 5,175 % 17/03/2046	18/04/2019	17 790	16 074	0,03
Chester A PLC 5,675 % échéance 17/03/2046	18/04/2019	10 947	9 769	0,02
Chester A PLC 6,425 % échéance 17/03/2046	18/04/2019	5 473	4 773	0,01
Constellation Oil Services Holding S.A. - Exp. 10/06/2071	10/06/2022	0	0	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. « B »	10/06/2022	353	353	0,00
Corestate Capital Holding S.A. 8,000 % échéance 15/04/2023	06/12/2022	1 050	1 068	0,00
Deutsche Bank AG 3,035 % échéance 28/05/2032	25/05/2021 - 29/09/2021	46 085	34 907	0,06

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	en % de l'actif net
Intelsat Emergence S.A.	19/06/2017 - 23/02/2022	$ 440 150	$ 111 580	0,19
Morgan Stanley 0,000 % échéance 02/04/2032	11/02/2020	59 641	39 123	0,07
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	08/12/2014 - 19/12/2019	37 976	207 693	0,36
Oracle Corp. 3,950 % échéance 25/03/2051	22/03/2021	18 508	13 289	0,02
Oracle Corp. 4,100 % échéance 25/03/2061	22/03/2021 - 05/10/2021	28 212	18 726	0,03
Sierra Hamilton Holder LLC	31/07/2017	560	0	0,00
Westmoreland Mining Holdings LLC	08/12/2014 - 19/12/2019	1 691	622	0,00
		$ 780 207	$ 562 770	0,97

(m) Des titres d'une juste valeur globale de 19 079 $ (31 décembre 2021 : 72 553 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un titre d'une juste valeur globale de 1 $ (31 décembre 2021 : 0 $) et un montant en numéraire de 273 $ (31 décembre 2021 : 1 875 $) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 1 599 431 $ (31 décembre 2021 : 1 730 912 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 56 679 $) et un montant en numéraire de 188 008 $ (31 décembre 2021 : 29 880 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Mesures de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur les marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 330 063	$ 65 894 167	$ 1 022 241	$ 67 246 471
Fonds d'investissement	1 793 842	287 586	0	2 081 428
Contrats de mise en pension	0	3 421 698	0	3 421 698
Instruments financiers dérivés[3]	35 705	1 477 546	3	1 513 254
Titres vendus à découvert	0	(734 103)	0	(734 103)
Totaux	**$ 2 159 610**	**$ 70 346 894**	**$ 1 022 244**	**$ 73 528 748**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur les marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 484 299	$ 75 419 974	$ 888 455	$ 76 792 728
Fonds d'investissement	2 811 875	0	0	2 811 875
Contrats de mise en pension	0	6 365 633	0	6 365 633
Instruments financiers dérivés[3]	(11 742)	1 055 957	0	1 044 215
Titres vendus à découvert	0	(484 196)	0	(484 196)
Totaux	**$ 3 284 432**	**$ 82 357 368**	**$ 888 455**	**$ 86 530 255**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Tableau des investissements Fonds Income Fund (suite)

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	en % de l'actif net
BRC	0,500 %	09/12/2022	TBD(1)	€ (2 590)	$ (2 764)	(0,01)
	0,550	21/09/2022	TBD(1)	(2 240)	(2 391)	0,00
DBL	(0,500)	01/12/2022	TBD(1)	(10 039)	(10 712)	(0,02)
Total des contrats de prise en pension					**$ (15 867)**	**(0,03)**

(1) Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Garantie (reçue)/nantie d'instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes(1)	Total de la juste valeur des dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes(1)
AZD	$ 2 601	$ (920)	$ 1 681	$ S/O	$ S/O	$ S/O
BOA	(36 145)	30 410	(5 735)	30 854	(28 170)	2 684
BOM	(1 847)	2 130	283	S/O	S/O	S/O
BPS	37 581	(31 520)	6 061	86 895	(58 410)	28 485
BRC	(19 965)	16 765	(3 200)	28 570	(16 980)	11 590
BSH	(15)	0	(15)	S/O	S/O	S/O
BYL	(1 443)	0	(1 443)	(2 174)	0	(2 174)
CBK	63 317	(64 234)	(917)	9 950	(10 843)	(893)
CLY	29	0	29	S/O	S/O	S/O
DUB	(21 446)	18 530	(2 916)	21 385	(21 610)	(225)
FAR	(2 129)	2 290	161	S/O	S/O	S/O
FBF	(4 557)	4 715	158	6 619	(6 000)	619
GLM	(618)	8 230	(8 848)	(23 168)	36 389	13 221
GSC	S/O	S/O	S/O	(224)	280	56
GST	(18 731)	8 496	(10 235)	19 477	(18 860)	617
HUS	1 179	(520)	659	28 486	(17 264)	11 222
IND	S/O	S/O	S/O	4 061	(3 840)	221
JPM	9 738	(8 970)	768	25 578	(24 590)	988
JPS	(1 195)	1 120	(75)	2 747	(2 440)	307
MBC	112 677	(90 850)	21 827	(10 168)	2 390	(7 778)
MEI	(363)	294	(69)	282	(290)	(8)
MYC	(9 537)	(29 220)	(38 757)	40 406	(52 747)	(12 341)
MYI	44 132	(35 730)	8 402	(38 319)	29 530	(8 789)
NAB	S/O	S/O	S/O	(42)	0	(42)
RBC	(1 592)	2 500	908	502	70	572
RYL	(10 431)	8 200	(2 231)	1 034	(930)	104
SAL	(15 988)	16 088	100	15 526	(15 040)	486
SCX	122 133	(112 350)	9 783	12 571	(8 410)	4 161
SOG	10	0	10	S/O	S/O	S/O
SSB	S/O	S/O	S/O	(3 562)	3 777	215
TOR	1 135	(920)	215	33 048	(22 120)	10 928
UAG	(36 981)	30 720	(6 261)	(7 067)	14 123	7 056

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Ce qui suit est une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières négociables admises à la cote sur une Bourse officielle	68,71	55,79
Valeurs mobilières négociables négociées sur un autre marché réglementé	45,07	44,39
Autres valeurs mobilières négociables	2,21	4,19
Fonds d'investissement	3,59	3,82
Contrats de mise en pension	5,90	8,65
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,15	(0,08)
Instruments financiers dérivés compensés	2,09	1,12
Instruments financiers dérivés hors cote	0,37	0,38
Titres vendus à découvert	(1,27)	(0,66)
Contrats de prise en pension	(0,03)	(0,10)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Crédits consortiaux et cessions	3,66	3,76
Obligations et billets privés	22,63	31,27
Obligations et billets convertibles	0,03	0,04
Obligations et billets municipaux	0,15	0,54
Agences du gouvernement américain	35,26	17,92
Obligations du Trésor américain	17,94	13,22

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Titres adossés à des hypothèques non émis par des agences	12,73	10,90
Titre adossé à des actifs	8,72	8,81
Émissions souveraines	5,29	6,91
Actions ordinaires	0,93	0,87
Droits	0,01	S/O
Bons de souscription	0,07	0,07
Titres de préférence	0,23	0,32
Sociétés d'investissement immobilier	0,34	0,26
Instruments à court terme	8,00	9,48
Fonds d'investissement	3,59	3,82
Contrats de mise en pension	5,90	8,65
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,16	(0,08)
Options vendues		
Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,01)	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	0,00	0,02
Swaps de défaillance de crédit sur indices de crédit — achat de protection	0,00	0,00
Swaps de défaillance de crédit sur indices de crédit — vente de protection	0,41	0,06
Swaps de taux d'intérêt	1,68	1,04
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,21	0,04
Options sur titres	S/O	0,01
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Options de change	S/O	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,17)	(0,05)
Options à taux d'intérêt plafonné	(0,10)	S/O
Options sur titres	(0,01)	(0,01)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — achat de protection	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	(0,06)	0,01
Swaps de défaillance de crédit sur indices de crédit — vente de protection	(0,06)	0,11
Swaps de taux d'intérêt	S/O	0,02
Swaps de rendement total sur indices	0,00	0,00
Swaps de rendement total sur titres	S/O	0,00
Contrats de change à terme	(0,26)	(0,03)
Contrats de change à terme couverts	0,82	0,28
Titres vendus à découvert	(1,27)	(0,66)
Autres actifs et passifs courants	(26,82)	(17,60)
Actifs nets	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Income Fund II

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES NÉGOCIABLES					
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS					
Air Canada					
8,130 % éch. 11/08/2028	$	199	$	197	0,35
CommScope, Inc.					
7,634 % éch. 06/04/2026		199		188	0,33
Intelsat Jackson Holdings S.A.					
7,445 % éch. 01/02/2029		18		18	0,03
Poseidon BidCo S.A.S					
5,250 % - 7,452 % éch. 14/07/2028	€	200		184	0,32
U.S. Renal Care, Inc.					
9,438 % éch. 26/06/2026	$	249		141	0,25
United Airlines, Inc.					
8,108 % éch. 21/04/2028		246		243	0,43
				971	1,71
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
BANQUE ET FINANCE					
AGFC Capital Trust					
5,829 % éch. 15/01/2067		440		247	0,44
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA					
1,875 % éch. 09/01/2026	€	200		184	0,33
Bank of Ireland Group PLC					
6,000 % éch. 01/09/2025 (c)(e)		200		199	0,35
BNP Paribas S.A.					
7,750 % éch. 16/08/2029 (c)(e)	$	300		297	0,52
Country Garden Holdings Co. Ltd.					
2,700 % éch. 12/07/2026		200		115	0,20
Credit Suisse Group AG					
5,250 % éch. 11/02/2027 (c)(e)		250		163	0,29
6,537 % éch. 12/08/2033		250		220	0,39
Deutsche Bank AG					
3,547 % éch. 18/09/2031		200		161	0,28
3,742 % éch. 07/01/2033		200		142	0,25
Ford Motor Credit Co. LLC					
2,386 % éch. 17/02/2026	€	100		98	0,17
Huarong Finance Co. Ltd.					
3,375 % éch. 24/02/2030	$	300		229	0,40
Intesa Sanpaolo SpA					
5,875 % éch. 01/09/2031 (c)(e)	€	250		216	0,38
Nationwide Building Society					
5,750 % éch. 20/06/2027 (c)(e)	£	200		216	0,38
Navient Corp.					
5,000 % éch. 15/03/2027	$	250		219	0,39
Swiss Insured Brazil Power Finance SARL					
9,850 % éch. 16/07/2032	BRL	1 055		176	0,31
UBS Group AG					
4,375 % éch. 10/02/2031 (c)(e)	$	250		191	0,34
4,875 % éch. 12/02/2027 (c)(e)		200		170	0,30
UniCredit SpA					
5,459 % éch. 30/06/2035		300		244	0,43
				3 487	6,15
INDUSTRIE					
American Airlines Pass-Through Trust					
3,375 % éch. 01/11/2028		501		418	0,75
Atlantia SpA					
1,875 % éch. 12/02/2028	€	300		267	0,47
Carvana Co.					
10,250 % éch. 01/05/2030	$	100		47	0,08
Charter Communications Operating LLC					
3,500 % éch. 01/06/2041		100		66	0,12
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.					
7,750 % éch. 15/04/2028		240		176	0,31
CSC Holdings LLC					
4,500 % éch. 15/11/2031		200		139	0,25
Directv Financing LLC					
5,875 % éch. 15/08/2027		350		314	0,55
DISH DBS Corp.					
5,250 % éch. 01/12/2026		130		110	0,19
5,750 % éch. 01/12/2028		130		104	0,18
Intelsat Jackson Holdings S.A.					
6,500 % éch. 15/03/2030		70		63	0,11
MGM China Holdings Ltd.					
4,750 % éch. 01/02/2027	$	200	$	177	0,31
NCL Corp. Ltd.					
5,875 % éch. 15/02/2027		150		130	0,23
Petroleos Mexicanos					
6,700 % éch. 16/02/2032		179		141	0,25
Prosus NV					
3,257 % éch. 19/01/2027		200		179	0,32
Studio City Co. Ltd.					
7,000 % éch. 15/02/2027		200		187	0,33
Venture Global Calcasieu Pass LLC					
3,875 % éch. 15/08/2029		200		175	0,31
				2 693	4,76
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS					
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC					
1,500 % éch. 17/02/2027	€	250		181	0,32
Pacific Gas & Electric Co.					
3,000 % éch. 15/06/2028	$	300		260	0,46
4,450 % éch. 15/04/2042 ^		250		187	0,33
5,250 % éch. 01/03/2052		200		164	0,29
5,900 % éch. 15/06/2032		300		294	0,52
Petrobras Global Finance BV					
6,850 % éch. 05/06/2115		45		38	0,07
7,250 % éch. 17/03/2044		42		41	0,07
				1 165	2,06
Total des Obligations et billets privés				7 345	12,97
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN					
Uniform Mortgage-Backed Security					
3,000 % éch. 01/08/2052		1 879		1 651	2,91
3,500 % éch. 01/05/2052		1 867		1 698	3,00
4,000 % éch. 01/09/2048 - 01/08/2049		34		32	0,06
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA					
2,500 % éch. 01/02/2053		300		254	0,45
3,000 % éch. 01/02/2053		900		791	1,40
3,500 % éch. 01/02/2053		3 200		2 910	5,14
4,000 % éch. 01/02/2053		3 100		2 909	5,14
4,500 % éch. 01/01/2053		400		385	0,68
5,500 % éch. 01/02/2053		500		501	0,88
6,000 % éch. 01/02/2053		100		101	0,18
				11 232	19,84
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN					
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (b)					
0,125 % éch. 15/07/2024		376		364	0,64
0,125 % éch. 15/10/2024		221		213	0,38
0,125 % éch. 15/02/2052		642		417	0,74
0,250 % éch. 15/07/2029		466		427	0,75
0,375 % éch. 15/07/2023		538		531	0,94
0,500 % éch. 15/04/2024		555		540	0,95
0,625 % éch. 15/01/2024		728		712	1,26
0,625 % éch. 15/07/2032		718		649	1,15
1,000 % éch. 15/02/2049		118		99	0,17
1,625 % éch. 15/10/2027		302		302	0,53
Billets du Trésor américain					
2,375 % éch. 31/03/2029		500		455	0,80
2,750 % éch. 15/05/2025		2 500		2 411	4,26
3,125 % éch. 15/08/2025		7 500		7 283	12,87
3,875 % éch. 30/09/2029		700		695	1,23
4,000 % éch. 31/10/2029		1 700		1 701	3,00
4,125 % éch. 15/11/2032		3 000		3 046	5,38
				19 845	35,05
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES					
1211 Avenue of the Americas Trust					
4,142 % éch. 10/08/2035		400		337	0,59
225 Liberty Street Trust					
4,501 % éch. 10/02/2036		500		441	0,78
280 Park Avenue Mortgage Trust					
5,773 % éch. 15/09/2034		100		92	0,16
Adjustable Rate Mortgage Trust					
4,629 % éch. 25/08/2036		688		260	0,46
Eurosail PLC					
2,286 % éch. 15/12/2044	€	573		586	1,03
2,445 % éch. 13/03/2045	€	500	$	473	0,83
GS Mortgage Securities Corp. Trust					
6,318 % éch. 15/11/2032	$	489		468	0,83
Harbour Energy PLC					
5,044 % éch. 28/01/2054	£	2 000		2 259	4,00
Hospitality Mortgage Trust					
6,318 % éch. 15/11/2036	$	178		169	0,30
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust					
3,735 % éch. 05/01/2031		457		457	0,81
Jupiter Mortgage PLC					
6,676 % éch. 20/07/2060	£	900		1 024	1,81
Lehman XS Trust					
4,749 % éch. 25/11/2035	$	432		373	0,66
Morgan Stanley Capital Trust					
5,518 % éch. 15/07/2035		450		438	0,77
Mortimer BTL PLC					
5,587 % éch. 21/06/2052	£	200		239	0,42
Newgate Funding PLC					
3,839 % éch. 01/12/2050		391		440	0,78
Residential Accredit Loans, Inc. Trust					
6,000 % éch. 25/09/2035 ^	$	128		111	0,19
6,000 % éch. 25/09/2035		129		111	0,20
Stratton Mortgage Funding PLC					
5,926 % éch. 20/07/2060	£	440		516	0,91
Trinity Square PLC					
5,629 % éch. 15/07/2059		500		576	1,02
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
3,864 % éch. 25/07/2037 ^	$	541		497	0,88
				9 867	17,43
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS					
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates					
6,189 % éch. 25/11/2034		400		373	0,66
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust					
4,609 % éch. 25/08/2037		270		229	0,40
4,609 % éch. 25/06/2047 ^		260		226	0,40
Dryden Euro CLO DAC					
2,188 % éch. 15/01/2032	€	240		251	0,44
First Franklin Mortgage Loan Trust					
4,129 % éch. 25/03/2036	$	732		643	1,13
Home Equity Asset Trust					
5,049 % éch. 25/04/2036		737		644	1,14
Long Beach Mortgage Loan Trust					
4,619 % éch. 25/12/2036		645		246	0,43
4,709 % éch. 25/10/2036		776		248	0,44
4,989 % éch. 25/02/2036		369		304	0,55
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust					
4,944 % éch. 25/01/2036		900		672	1,19
New Century Home Equity Loan Trust					
5,124 % éch. 25/10/2035		700		577	1,02
Segovia European CLO DAC					
2,336 % éch. 20/07/2032	€	200		207	0,36
Structured Asset Investment Loan Trust					
5,364 % éch. 25/05/2035	$	711		600	1,06
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust					
4,679 % éch. 25/07/2036 ^		665		638	1,13
				5 858	10,35
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Obligation internationale du gouvernement argentin					
0,500 % éch. 09/07/2030		160		44	0,08
1,500 % éch. 09/07/2035		179		46	0,08
3,500 % éch. 09/07/2041		272		78	0,14
3,875 % éch. 09/01/2038		63		20	0,03
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos					
4,500 % éch. 01/03/2026	CLP	50 000		56	0,10
Obligation internationale du gouvernement mexicain					
10,000 % éch. 05/12/2024	MXN	10 000		514	0,91
ıtion internationale du gouvernement péruvien					
6,900 % éch. 12/08/2037	PEN	500		118	0,21
Obligation internationale du gouvernement roumain					
3,750 % éch. 07/02/2034	€	220		176	0,31

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Obligation internationale du gouvernement russe				
4,875 % éch. 16/09/2023 ^	$	200	$ 165	0,29
5,250 % éch. 23/06/2047 ^		200	74	0,13
Obligation internationale du gouvernement sud-africain				
10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	5 900	366	0,65
Obligation internationale du gouvernement turc				
5,750 % éch. 11/05/2047	$	250	171	0,30
			1 828	3,23

	ACTIONS		
ACTIONS ORDINAIRES			
ÉTATS FINANCIERS			
Intelsat Emergence S.A. (a)(f)	935	22	0,04

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
DROITS			
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05/12/2025	194	$ 2	0,00
Total des valeurs mobilières		**$ 56 970**	**100,62**
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)	174 823	1 740	3,07
Total Fonds d'investissement		**$ 1 740**	**3,07**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2026	1	$ 3	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2026	1	2	0,00
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023 (1)	Court	01/2023	1	1	0,00
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023(1)	Court	01/2023	1	(5)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Court	03/2023	5	3	0,01
				$ 4	0,01

(1) Option Future style (Style futur).

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Nbre de contrats	Prime	Juste valeur	en % de l'actif net
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	$ 98,000	15/12/2023	1	$ (1)	$ 0	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	1	(1)	(3)	(0,01)
				$ (2)	$ (3)	(0,01)
Total des instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé					**$ 1**	**0,00**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE DE CRÉDIT SUR INDICES DE CRÉDIT – VENTE DE PROTECTION(1)

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel(2)	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
Indice CDX.EM-36 à 5 ans	1,000 %	20/12/2026	$ 644	$ 10	0,02
Indice CDX.EM-38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	1 500	12	0,02
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000	20/12/2027	4 500	134	0,24
				$ 156	0,28

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,000 %	16/06/2028	¥ 130 000	$ 31	0,06
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,000	15/12/2028	530 000	32	0,06
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,200	15/12/2041	30 000	13	0,02
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,400	15/06/2032	40 000	12	0,02
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,250	15/06/2032	$ 10	2	0,00
À recevoir(3)	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,600	16/01/2026	700	17	0,03
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2029	300	15	0,03
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	1,750	21/12/2052	800	(29)	(0,05)
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2027	50	0	0,00
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2029	360	0	0,00
À recevoir(3)	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,300	17/01/2026	500	12	0,02

Tableau des investissements Fonds Income Fund II (suite)

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
À recevoir[3]	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,350 %	17/01/2025	$ 900	$ 13	0,02
À recevoir[3]	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,450	20/12/2024	1 800	27	0,05
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,880	30/09/2027	300	(10)	(0,02)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,900	04/10/2027	300	(10)	(0,02)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	2,955	04/10/2027	100	(3)	(0,01)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	3,050	07/09/2027	100	(3)	0,00
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029	100	(3)	(0,01)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	3,050	06/09/2032	100	(3)	(0,01)
À payer	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	3,100	09/09/2029	100	(3)	0,00
À recevoir	Indice USD-Secured Overnight Financing Rate composé-OIS à 1 jour	3,610	12/12/2032	100	0	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	16/06/2051	450	126	0,21
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028	€ 400	19	0,04
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	700	20	0,04
					$ 275	0,48
Total des instruments financiers dérivés compensés					**$ 431**	**0,76**

(1) Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

(2) Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, tel que défini par les termes de ce contrat de swap précis.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Voir note 2, Transactions sur titres et revenus sur investissements, dans les Notes relatives aux États financiers pour plus d'informations.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contre-partie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	en % de l'actif net
BOA	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150 %	01/12/2023	100	$ 0	$ 0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	01/12/2023	100	0	(1)	0,00
BPS	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	28/04/2023	100	0	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	28/04/2023	100	0	(2)	(0,01)
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,150	09/01/2023	100	0	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	09/01/2023	100	0	(1)	0,00
BRC	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	12/01/2023	100	0	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	12/01/2023	100	0	0	0,00
CBK	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,150	09/01/2023	100	0	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	09/01/2023	100	0	(1)	0,00
DUB	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	100	(1)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,790	08/04/2024	100	(1)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,790	08/04/2024	100	(1)	(1)	0,00
GLM	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	100	(1)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	100	(1)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	100	(1)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	100	(1)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	100	(1)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	100	(1)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	100	(1)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	100	(1)	(2)	(0,01)
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	100	(1)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,088	03/11/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,910	10/11/2023	100	(1)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,910	10/11/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	100	0	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	100	0	(1)	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	100	0	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/11/2023	100	0	(1)	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	100	0	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	100	0	(1)	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,697	02/04/2024	100	(1)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,697	02/04/2024	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	05/04/2023	100	0	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	05/04/2023	100	0	(2)	(0,01)
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	11/04/2023	200	0	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	11/04/2023	200	0	(3)	(0,01)

Contre-partie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant du notionnel[1]	Prime	Juste valeur	en % de l'actif net
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700 %	26/04/2023	100	$ 0	$ 0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	26/04/2023	100	0	(2)	(0,01)
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	15/05/2023	100	0	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 1 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	15/05/2023	100	0	(2)	(0,01)
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547	07/03/2023	100	(2)	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	100	(2)	(6)	(0,01)
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	200	(2)	(1)	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 10 ans marché hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	200	(3)	(7)	(0,01)
	Option d'achat – Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,230	23/01/2023	100	0	0	0,00
	Option de vente – Swap de taux d'intérêt à 5 ans marché hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,730	23/01/2023	100	0	(1)	0,00
							$ (33)	$ (45)	(0,08)

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	en % de l'actif net
BOA	Option d'achat – Uniform Mortgage-Backed Security de gré à gré, TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	$ 101,891	05/01/2023	100	$ 0	$ 0	0,00
	Option de vente – Titre adossé à des créances hypothécaires hors cote, TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	100,000	06/02/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat – Uniform Mortgage-Backed Security de gré à gré, TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	102,000	06/02/2023	100	(1)	0	0,00
					$ (2)	$ (1)	0,00

[1] Le montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES OU MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	en % de l'actif net
MYC	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000 %	20/12/2026	$ 200	$ (9)	$ 1	$ (8)	(0,01)

[1] Si le Fonds est vendeur de protection et que survient un évènement de crédit, tel que défini aux termes de ce contrat de swap précis, le Fonds paiera (i) à l'acheteur de la protection un montant égal au montant nominal du swap et prendra livraison de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence ou (ii) un règlement net, sous forme de numéraire, titres ou autres obligations livrables, égal au montant notionnel du swap minoré de la valeur résiduelle de l'obligation de référence ou des titres sous-jacents qui composent l'indice de référence.

[2] Montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, tel que défini par les termes de ce contrat de swap précis.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	02/2023	CAD	376	$	276	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	02/2023	€	23		24	0	0	0	0,00
	02/2023	£	4 398		5 189	0	(108)	(108)	(0,19)
	02/2023	$	96	€	92	2	0	2	0,00
	02/2023		877	¥	120 600	43	0	43	0,08
	03/2023	TWD	1 207	$	41	1	0	1	0,00
BPS	01/2023	$	30	BRL	163	1	0	1	0,00
	01/2023		530	KRW	692 166	21	0	21	0,04
	02/2023	€	2 822	$	2 926	0	(95)	(95)	(0,17)
	02/2023	$	19	IDR	299 438	0	0	0	0,00
	03/2023		116	CNY	800	1	0	1	0,00
BRC	01/2023	CNH	298	$	43	0	0	0	0,00
	03/2023	$	98	IDR	1 531 771	1	0	1	0,00
CBK	01/2023	CLP	23 403	$	26	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	565	BRL	2 966	0	(3)	(3)	(0,01)
	01/2023		25	CLP	23 395	3	0	3	0,01
	01/2023		122	PEN	490	6	0	6	0,01
	02/2023		182	AUD	270	1	0	1	0,00
	02/2023		26	CLP	23 532	1	0	1	0,00
	02/2023		268	NZD	415	0	(5)	(5)	(0,01)
	03/2023		948	MXN	19 043	18	0	18	0,03
	04/2023	PEN	1 276	$	320	0	(12)	(12)	(0,02)
	05/2023	MXN	18 199		900	0	(12)	(12)	(0,02)
GLM	01/2023	BRL	3 129		587	0	(5)	(5)	(0,01)
	01/2023	CNH	309		44	0	0	0	0,00
	01/2023	HKD	86		11	0	0	0	0,00
	03/2023	MXN	725		37	0	0	0	0,00
	03/2023	$	3	MXN	61	0	0	0	0,00
	04/2023		577	BRL	3 129	6	0	6	0,01
	05/2023	PEN	137	$	34	0	(1)	(1)	0,00
	05/2023	$	46	PEN	186	2	0	2	0,00
	05/2023	ZAR	51	$	3	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	HKD	359		46	0	0	0	0,00
	02/2023	$	283	CAD	375	0	(6)	(6)	(0,01)
	03/2023		59	IDR	929 106	1	0	1	0,00
	05/2023	CNH	191	$	28	1	0	1	0,00

Tableau des investissements Fonds Income Fund II (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
MYI	01/2023	AUD	53	$	36	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	HKD	703		90	0	0	0	0,00
	01/2023	$	42	KRW	52 421	0	0	0	0,00
	01/2023	ZAR	846	$	47	0	(2)	(2)	0,00
	02/2023	€	12		13	0	0	0	0,00
	02/2023	TWD	2 267		74	0	0	0	0,00
	02/2023	$	883	AUD	1 300	0	0	0	0,00
	02/2023	ZAR	5 707	$	320	0	(15)	(15)	(0,02)
	03/2023	TWD	3 770		128	4	0	4	0,01
	03/2023	$	83	IDR	1 309 107	1	0	1	0,00
SCX	02/2023		55	€	52	0	0	0	0,00
	02/2023		13	IDR	199 609	0	0	0	0,00
UAG	02/2023		54		858 208	1	0	1	0,00
						$ 115	$ (266)	$ (151)	(0,27)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en AUD (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
AZD	01/2023	$	512	AUD	759	$ 3	$ 0	$ 3	0,01
BOA	01/2023	AUD	5	$	3	0	0	0	0,00
CBK	01/2023		8		5	0	0	0	0,00
	01/2023	$	274	AUD	402	0	(2)	(2)	0,00
MBC	01/2023		102		151	1	0	1	0,00
MYI	01/2023		272		405	3	0	3	0,00
UAG	01/2023		242		358	1	0	1	0,00
						$ 8	$ (2)	$ 6	0,01

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en EUR (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
CBK	01/2023	€	23	$	24	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$	1 132	€	1 088	31	0	31	0,05
MBC	01/2023	€	13	$	14	0	0	0	0,00
	01/2023	$	1 218	€	1 161	22	0	22	0,04
SCX	01/2023		1 041		1 000	27	0	27	0,05
						$ 80	$ 0	$ 80	0,14

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en GBP (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	$	1 091	£	905	$ 0	$ (2)	$ (2)	0,00
BRC	01/2023	£	11	$	14	0	0	0	0,00
	01/2023	$	246	£	200	0	(6)	(6)	(0,01)
MBC	01/2023		1 106		922	5	(2)	3	0,00
MYI	01/2023		48		39	0	(1)	(1)	0,00
UAG	01/2023	£	6	$	7	0	0	0	0,00
	01/2023	$	905	£	754	1	0	1	0,00
						$ 6	$ (11)	$ (5)	(0,01)

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en SGD (couverte) de Distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	en % de l'actif net
BOA	01/2023	$	73	SGD	101	$ 2	$ 0	$ 2	0,01
BPS	01/2023		75		103	2	0	2	0,00
BRC	01/2023	SGD	24	$	18	0	0	0	0,00
	01/2023	$	2	SGD	2	0	0	0	0,00
GLM	01/2023		13		18	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	SGD	308	$	228	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	79	SGD	108	1	0	1	0,00
						$ 5	$ (1)	$ 4	0,01

Total des instruments financiers dérivés hors cote	**$ (120)**	**(0,21)**
Total des investissements	**$ 59 022**	**104,24**
Autres actifs et passifs courants	**$ (2 399)**	**(4,24)**
Actifs nets	**$ 56 623**	**100,00**

ANNEXES À L'ÉTAT DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* **Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

^ **Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.**

(a) **Le titre n'a pas généré de revenu au cours des douze derniers mois.**

(b) **Le montant du principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.**

(c) **Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.**

(d) **Affilié au Fonds.**

(e) **Titre convertible conditionnel.**

(f) **Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : néant) :**

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	en % de l'actif net
Intelsat Emergence S.A.	24/02/2021	$ 77	$ 22	0,04

Un montant en numéraire de 961 $ (31 décembre 2021 : 155 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 1 $) et un montant en numéraire de 61 $ (31 décembre 2021 : 0 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 0	$ 56 688	$ 282	$ 56 970
Fonds d'investissement	1 740	0	0	1 740
Instruments financiers dérivés[3]	(4)	316	0	312
Totaux	**$ 1 736**	**$ 57 004**	**$ 282**	**$ 59 022**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières négociables	$ 0	$ 26 438	$ 76	$ 26 514
Fonds d'investissement	2 701	0	0	2 701
Instruments financiers dérivés[3]	0	51	0	51
Totaux	**$ 2 701**	**$ 26 489**	**$ 76**	**$ 29 266**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie d'instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Juste valeur totale des dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions Expositions nettes[1]
AZD	$ 3	$ 0	$ 3	$ S/O	$ S/O	$ S/O
BOA	(65)	0	(65)	8	0	$ 8
BPS	(73)	0	(73)	9	0	9
BRC	(5)	0	(5)	2	0	2
CBK	24	0	24	6	0	6
DUB	(2)	0	(2)	S/O	S/O	S/O
GLM	(36)	30	(6)	(5)	1	(4)
HUS	S/O	S/O	S/O	20	0	20
MBC	22	0	22	S/O	S/O	S/O
MYC	(8)	31	23	S/O	S/O	S/O
MYI	(10)	0	(10)	2	0	2
RYL	S/O	S/O	S/O	1	0	1
SCX	27	0	27	5	0	5
SSB	S/O	S/O	S/O	1	0	1
UAG	3	0	3	(11)	0	(11)

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Ce qui suit est une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières négociables admises à la cote sur une Bourse officielle	55,36	51,64
Valeurs mobilières négociables négociées sur un autre marché réglementé	45,23	37,86
Autres valeurs mobilières négociables	0,03	5,97
Fonds d'investissement	3,07	9,73
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,00	S/O
Instruments financiers dérivés compensés	0,76	0,05
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,21)	0,14

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Crédits consortiaux et cessions	1,71	2,12
Obligations et billets privés	12,97	29,17
Agences du gouvernement américain	19,84	12,14
Obligations du Trésor américain	35,05	3,33
Titres adossés à des hypothèques non émis par des agences	17,43	16,66
Titre adossé à des actifs	10,35	9,34
Émissions souveraines	3,23	5,79
Actions ordinaires	0,04	S/O
Droits	0,00	S/O
Instruments à court terme	S/O	16,92
Fonds d'investissement	3,07	9,73
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,01	S/O
Options vendues		
Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,01)	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance de crédit sur indices de crédit — vente de protection	0,28	S/O
Swaps de taux d'intérêt	0,48	0,05
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Swaptions de taux d'intérêt	(0,08)	S/O
Options sur titres	0,00	S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines ou municipales américaines — vente de protection	(0,01)	S/O
Contrats de change à terme	(0,27)	0,08
Contrats de change à terme couverts	0,15	0,06
Autres actifs et passifs courants	(4,24)	(5,39)
Actifs nets	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	% DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES NÉGOCIABLES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				
Bank of America Corp.				
5,875 % éch. 15/03/2028 (e)	$	60	$ 53	0,01
Jyske Realkredit A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	6 622	700	0,17
1,500 % éch. 01/10/2053		5 017	541	0,13
2,500 % éch. 01/10/2047		1	0	0,00
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
1,000 % éch. 01/10/2050		0	0	0,00
1,000 % éch. 01/10/2053		291	31	0,01
1,500 % éch. 01/10/2053		13 435	1 421	0,35
2,000 % éch. 01/10/2053		200	23	0,01
2,500 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050		23 735	2 511	0,62
1,000 % éch. 01/10/2053		2 332	242	0,06
1,500 % éch. 01/10/2053		29 471	3 151	0,78
2,000 % éch. 01/10/2053		497	57	0,01
2,500 % éch. 01/10/2047		3	0	0,00
3,500 % éch. 01/10/2053		3 684	486	0,12
Realkredit Danmark A/S				
1,000 % éch. 01/10/2050		12 376	1 310	0,33
1,000 % éch. 01/10/2053		586	61	0,02
1,500 % éch. 01/10/2050		1 310	142	0,04
1,500 % éch. 01/10/2053		11 170	1 190	0,30
2,500 % éch. 01/04/2047		2	0	0,00
			11 919	2,96
INDUSTRIE				
eBay, Inc.				
2,750 % éch. 30/01/2023	$	100	100	0,02
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
Petrobras Global Finance BV				
7,250 % éch. 17/03/2044		157	151	0,04
Total des Obligations et billets privés			12 170	3,02
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Freddie Mac				
4,718 % éch. 15/06/2047		707	680	0,17
Ginnie Mae				
3,858 % éch. 20/08/2068		98	95	0,02
4,626 % éch. 20/08/2072		2 362	2 354	0,58
4,726 % éch. 20/10/2072		4 712	4 639	1,15
4,986 % éch. 20/11/2072		1 900	1 922	0,48
Uniform Mortgage-Backed Security, TBA				
3,000 % éch. 01/02/2053		6 700	5 887	1,46
4,000 % éch. 01/01/2053		14 900	13 976	3,47
4,500 % éch. 01/02/2053		7 200	6 931	1,72
5,000 % éch. 01/02/2053		5 800	5 715	1,42
			42 199	10,47
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (d)				
0,125 % éch. 15/04/2025		2 076	1 979	0,49
0,125 % éch. 15/04/2026		2 727	2 564	0,64
0,125 % éch. 15/07/2026		186	176	0,04
0,125 % éch. 15/10/2026		13 413	12 576	3,12
0,125 % éch. 15/04/2027		844	787	0,19
0,125 % éch. 15/01/2030		116	104	0,03
0,125 % éch. 15/07/2030		465	417	0,10
0,125 % éch. 15/07/2031		12 340	10 913	2,71
0,125 % éch. 15/01/2032		9 352	8 198	2,03
0,125 % éch. 15/02/2051		1 030	664	0,16
0,125 % éch. 15/02/2052		642	417	0,10
0,250 % éch. 15/02/2050		116	78	0,02
0,375 % éch. 15/01/2027		1 715	1 618	0,40
0,375 % éch. 15/07/2027		10 695	10 084	2,50
0,500 % éch. 15/04/2024		1 300	1 264	0,31
0,500 % éch. 15/01/2028		2 899	2 728	0,68
0,625 % éch. 15/04/2023		480	475	0,12
0,625 % éch. 15/01/2024		66	65	0,02
0,625 % éch. 15/01/2026		125	120	0,03
0,625 % éch. 15/07/2032		35 382	32 436	8,05
0,625 % éch. 15/02/2043		13	11	0,00
0,750 % éch. 15/07/2028	$	2 149	$ 2 048	0,51
0,750 % éch. 15/02/2042		659	552	0,14
0,750 % éch. 15/02/2045		4 049	3 278	0,81
0,875 % éch. 15/01/2029		2 549	2 430	0,60
0,875 % éch. 15/02/2047		6 174	5 068	1,26
1,000 % éch. 15/02/2046		2 980	2 534	0,63
1,000 % éch. 15/02/2048		423	356	0,09
1,375 % éch. 15/02/2044		2 046	1 902	0,47
1,625 % éch. 15/10/2027		11 165	11 157	2,77
2,000 % éch. 15/01/2026		32	32	0,01
2,125 % éch. 15/02/2040		69	73	0,02
2,125 % éch. 15/02/2041		816	866	0,21
			117 970	29,26
TITRES ADOSSÉS À DES HYPOTHÈQUES NON ÉMIS PAR DES AGENCES				
1211 Avenue of the Americas Trust				
3,901 % éch. 10/08/2035		1 900	1 767	0,44
Banc of America Alternative Loan Trust				
6,000 % éch. 25/06/2046		190	165	0,04
Banc of America Funding Trust				
3,775 % éch. 20/01/2047		208	176	0,04
6,000 % éch. 25/03/2034		71	71	0,02
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				
4,579 % éch. 25/01/2037		2 900	2 468	0,61
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
5,500 % éch. 25/08/2034		257	236	0,06
CityLine Commercial Mortgage Trust				
2,778 % éch. 10/11/2031		2 475	2 384	0,59
Countrywide Alternative Loan Trust				
6,000 % éch. 25/04/2037		103	88	0,02
HarborView Mortgage Loan Trust				
5,253 % éch. 20/06/2035		54	47	0,01
JPMorgan Mortgage Trust				
2,861 % éch. 25/06/2035		0	0	0,00
MRCD Mark Mortapage Trust				
2,718 % éch. 15/12/2036		2 598	2 391	0,59
New Residential Mortgage Loan Trust				
4,500 % éch. 25/05/2058		156	147	0,04
One Market Plaza Trust				
3,614 % éch. 10/02/2032		2 000	1 925	0,48
Polaris PLC				
4,232 % éch. 23/10/2059	£	383	450	0,11
Sequoia Mortgage Trust				
4,753 % éch. 20/07/2036	$	173	148	0,04
Towd Point Mortgage Trust				
3,500 % éch. 25/01/2058		2 230	2 031	0,51
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
4,180 % éch. 25/09/2033		1	1	0,00
5,049 % éch. 25/01/2045		191	173	0,04
5,409 % éch. 25/08/2045		1 808	1 700	0,42
			16 368	4,06
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,169 % éch. 25/05/2034		71	71	0,02
Asset-Backed Funding Certificates Trust				
4,989 % éch. 25/10/2034		68	68	0,02
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
5,019 % éch. 25/02/2036		123	123	0,03
CIT Mortgage Loan Trust				
5,739 % éch. 25/10/2037		32	32	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust				
4,679 % éch. 25/09/2036		108	103	0,03
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,334 % éch. 25/10/2034		162	156	0,04
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,569 % éch. 25/06/2047		2 212	2 054	0,51
Encore Credit Receivables Trust				
5,289 % éch. 25/01/2036		900	859	0,21
First Franklin Mortgage Loan Trust				
4,699 % éch. 25/07/2036		158	148	0,04
5,169 % éch. 25/09/2035		90	89	0,02
5,259 % éch. 25/09/2035		207	203	0,05
Home Equity Asset Trust				
5,244 % éch. 25/08/2034	$	143	$ 140	0,03
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
4,709 % éch. 25/05/2037		24	24	0,01
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
4,709 % éch. 25/07/2036		1 675	1 627	0,40
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,049 % éch. 25/01/2035		125	120	0,03
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
6,189 % éch. 25/12/2034		751	730	0,18
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust				
4,699 % éch. 25/06/2047 ^		1 986	1 824	0,45
Residential Asset Securities Corp. Trust				
4,669 % éch. 25/09/2036		995	963	0,24
4,884 % éch. 25/04/2036		42	41	0,01
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
4,649 % éch. 25/12/2036		1 926	1 745	0,43
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
6,114 % éch. 25/11/2035		1 000	980	0,24
			12 100	3,00
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement australien				
0,250 % éch. 21/11/2032	AUD	4 550	1 596	0,40
0,750 % éch. 21/11/2027		1 092	460	0,11
3,000 % éch. 20/09/2025		1 547	838	0,21
Obligation à rendement réel du gouvernement canadien				
0,500 % éch. 01/12/2050 (d)	CAD	237	146	0,04
1,250 % éch. 01/12/2047 (d)		2 183	1 612	0,40
Obligation internationale du gouvernement danois				
0,100 % éch. 15/11/2023 (d)	DKK	3 547	511	0,13
Obligation internationale du gouvernement français				
0,100 % éch. 01/03/2028 (d)	€	905	967	0,24
0,100 % éch. 25/07/2031 (d)		1 955	1 998	0,50
0,100 % éch. 25/07/2038 (d)		960	919	0,23
0,700 % éch. 25/07/2030 (d)		1 571	1 688	0,42
1,800 % éch. 25/07/2040 (d)		41	51	0,01
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
0,100 % éch. 15/05/2023 (d)		59	63	0,02
0,400 % éch. 15/05/2030 (d)		2 216	2 071	0,51
1,400 % éch. 26/05/2025 (d)		6 914	7 285	1,81
2,350 % éch. 15/09/2024 (d)		1 156	1 272	0,32
2,600 % éch. 15/09/2023 (d)		550	599	0,15
Obligation internationale du gouvernement japonais				
0,005 % éch. 10/03/2031 (d)	¥	20 875	164	0,04
0,100 % éch. 10/03/2024 (d)		422 370	3 268	0,81
0,100 % éch. 10/03/2028 (d)		948 331	7 435	1,84
0,100 % éch. 10/03/2029 (d)		641 105	12 911	3,20
Obligation internationale du gouvernement qatari				
3,875 % éch. 23/04/2023	$	200	199	0,05
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie Saoudite				
4,000 % éch. 17/04/2025		380	375	0,09
Obligation internationale du gouvernement espagnol				
0,650 % éch. 30/11/2027 (d)	€	10 689	11 276	2,80
0,700 % éch. 30/11/2033 (d)		1 657	1 653	0,41
1,450 % éch. 31/10/2027		300	296	0,07

Tableau des investissements Fonds Inflation Multi-Asset Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Bon du Trésor britannique			
0,125 % éch. 10/08/2028 (d)	£ 306	$ 369	0,09
0,125 % éch. 10/08/2031 (d)	1 818	2 202	0,55
0,125 % éch. 22/11/2036 (d)	164	191	0,05
0,125 % éch. 22/03/2039 (d)	360	412	0,10
0,125 % éch. 10/08/2041 (d)	1 614	1 830	0,45
0,125 % éch. 22/03/2044 (d)	587	651	0,16
0,125 % éch. 22/03/2046 (d)	1 824	1 994	0,49
0,125 % éch. 10/08/2048 (d)	1 749	1 890	0,47
0,125 % éch. 22/03/2051 (d)	460	494	0,12
0,250 % éch. 22/03/2052 (d)	1 323	1 483	0,37
0,500 % éch. 22/03/2050 (d)	1 384	1 650	0,41
0,625 % éch. 22/03/2040 (d)	247	306	0,08
0,625 % éch. 22/11/2042 (d)	838	1 040	0,26
0,750 % éch. 22/11/2047 (d)	2 141	2 693	0,67
1,250 % éch. 22/11/2027 (d)	1 944	2 476	0,61
1,250 % éch. 22/11/2032 (d)	377	503	0,12
4,125 % éch. 22/07/2030	499	810	0,20
		80 647	20,01
	ACTIONS		
ACTIONS ORDINAIRES			
SERVICES DE COMMUNICATION			
Activision Blizzard, Inc.	2 060	158	0,04
TEGNA, Inc.	9 670	205	0,05
		363	0,09
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE			
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	121	15	0,00
Marriott International, Inc. 'A'	121	18	0,01
		33	0,01
ÉTATS FINANCIERS			
First Horizon Corp.	9 765	239	0,06
SOIN DE SANTÉ			
Horizon Therapeutics PLC (a)	3 600	410	0,10
LHC Group, Inc. (a)	1 809	292	0,07
		702	0,17
IMMOBILIER			
CBRE Group, Inc. « A » (a)	428	33	0,01
Howard Hughes Corp. (a)	754	58	0,01
		91	0,02
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS			
PNM Resources, Inc.	1 296	63	0,02
		1 491	0,37
TITRES DE PRÉFÉRENCE			
Nationwide Building Society 10,250 %	3 685	555	0,14
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT IMMOBILIER			
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	1 558	227	0,06
American Assets Trust, Inc.	1 851	49	0,01
American Homes 4 Rent 'A'	5 875	177	0,04
American Tower Corp.	920	195	0,05
Americold Realty Trust, Inc.	1 823	52	0,01
Apartment Income REIT Corp.	2 639	$ 91	0,02
AvalonBay Communities, Inc.	1 535	248	0,06
Camden Property Trust	430	48	0,01
Crown Castle, Inc.	423	57	0,01
CubeSmart	1 825	73	0,02
Digital Realty Trust, Inc.	1 470	147	0,04
Equinix, Inc.	210	138	0,03
Equity LifeStyle Properties, Inc.	3 818	247	0,06
Equity Residential	3 866	228	0,06
Essex Property Trust, Inc.	530	112	0,03
Extra Space Storage, Inc.	429	63	0,02
First Industrial Realty Trust, Inc.	3 127	151	0,04
Gaming and Leisure Properties, Inc.	2 793	145	0,04
Healthpeak Properties, Inc.	5 384	135	0,03
Host Hotels & Resorts, Inc.	4 835	78	0,02
Invitation Homes, Inc.	12 792	379	0,09
Kilroy Realty Corp.	1 217	47	0,01
Life Storage, Inc.	718	71	0,02
Mid-America Apartment Communities, Inc.	563	88	0,02
National Storage Affiliates Trust	3 400	123	0,03
Prologis, Inc.	6 603	744	0,19
Public Storage	1 461	409	0,10
Realty Income Corp.	675	43	0,01
Regency Centers Corp.	508	32	0,01
Retail Opportunity Investments Corp.	2 171	33	0,01
Rexford Industrial Realty, Inc.	1 918	105	0,03
RLJ Lodging Trust	10 141	107	0,03
Ryman Hospitality Properties, Inc.	1 000	82	0,02
Safehold, Inc.	509	15	0,00
SBA Communications Corp.	798	224	0,06
Simon Property Group, Inc.	2 893	340	0,08
SITE Centers Corp.	2 914	40	0,01
Sun Communities, Inc.	1 780	255	0,06
Sunstone Hotel Investors, Inc.	5 417	52	0,01
UDR, Inc.	2 352	91	0,02
Ventas, Inc.	4 504	226	0,06
VICI Properties, Inc.	21 246	688	0,17
WP Carey, Inc.	2 526	197	0,05
		7 052	1,75
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BILLETS DE TRÉSORERIE			
Consolidated Edison Co. of New York, Inc. 4,800 % éch. 17/01/2023	$ 250	249	0,06
4,800 % éch. 18/01/2023	250	249	0,06
Constellation Brands, Inc. 5,000 % éch. 09/01/2023	250	250	0,07
5,000 % éch. 10/01/2023	250	250	0,07
Crown Castle International Corp. 5,100 % éch. 09/01/2023	790	789	0,20
Dominion Resources, Inc. 4,700 % éch. 01/02/2023	250	249	0,06
Duke Energy Corp. 4,620 % éch. 11/01/2023	$ 250	$ 250	0,07
Électricité de France S.A. 5,000 % éch. 20/01/2023	250	249	0,06
Enel Finance America LLC 6,000 % éch. 12/01/2023	250	249	0,06
Energy Transfer Partners LP 5,080 % éch. 05/01/2023	250	250	0,06
Entergy Corp. 4,700 % éch. 12/01/2023	250	250	0,06
Humana, Inc. 4,850 % éch. 10/01/2023	250	250	0,06
McCormick & Co., Inc. 4,750 % éch. 27/01/2023	250	249	0,06
Tampa Electric Co. 4,800 % éch. 12/01/2023	250	250	0,06
Targa Resources Corp. 5,250 % éch. 13/01/2023	250	249	0,06
Thomson Reuters Corp. 4,770 % éch. 25/01/2023	500	498	0,13
Vodafone Group PLC 4,600 % éch. 05/01/2023	250	250	0,06
VW Credit, Inc. 4,800 % éch. 26/01/2023	250	249	0,06
Walgreens Boots Alliance, Inc. 4,900 % éch. 11/01/2023	250	250	0,06
4,950 % éch. 18/01/2023	250	249	0,06
		5 778	1,44
BILLETS À COURT TERME			
Federal Home Loan Bank 4,320 % éch. 06/01/2023	8 700	8 700	2,16
4,320 % éch. 10/01/2023	4 400	4 400	1,09
4,345 % éch. 23/02/2023	4 200	4 200	1,04
		17 300	4,29
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
3,642 % éch. 17/01/2023 (b)(c)	6 500	6 491	1,61
Total instruments à court terme		29 569	7,34
Total des valeurs mobilières		**$ 320 121**	**79,42**
	ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	3 977 513	39 592	9,82
FONDS INDICIELS COTÉS			
Invesco Physical Gold ETC	108 899	19 147	4,75
iShares Physical Gold ETC	288 780	10 236	2,54
		29 383	7,29
Total Fonds d'investissement		**$ 68 975**	**17,11**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux directeur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Accords de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	en % de l'actif net
GSC	4,330 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 37 700	Freddie Mac 4,000 % échéance 01/09/2052	$ (38 846)	$ 37 700	$ 37 718	9,34
SSB	1,900	30/12/2022	03/01/2023	3 020	Billet du Trésor américain 1,875 % échéance 30/06/2026	(3 080)	3 020	3 020	0,76
Total des contrats de mise en pension						**$ (41 926)**	**$ 40 720**	**$ 40 738**	**10,10**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans mars	Court	03/2023	8	$ 8	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars	Court	03/2023	1	4	0,00
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023	Court	01/2023	8	6	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Court	03/2023	38	148	0,04
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	Court	03/2023	18	68	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Long	03/2023	11	(23)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	Court	03/2023	49	874	0,22
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars	Court	03/2023	7	66	0,02
Contrats à terme standardisés sur Euro-Schatz mars	Court	03/2023	385	522	0,13
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Court	03/2023	35	711	0,17
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023	Court	01/2023	8	(41)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Long	03/2023	17	0	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	429	(586)	(0,15)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Court	03/2023	116	(37)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Court	03/2023	76	80	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	258	591	0,15
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Long	03/2023	101	(410)	(0,10)
				$ 1 981	0,49
Total des instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé				**$ 1 981**	**0,49**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE DE CRÉDIT SUR INDICES DE CRÉDIT – VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
Indice CDX.EM-31 à 5 ans	1,000 %	20/06/2024	$ 430	$ 0	0,00
Indice CDX.EM-36 à 5 ans	1,000	20/12/2026	552	(1)	0,00
Indice CDX.EM-38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	100	2	0,00
				$ 1	0,00

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	en % de l'actif net
À recevoir	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	0,500 %	16/03/2042	£ 2 200	$ 27	0,01
À payer	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	1,500	15/06/2052	12 100	(3 195)	(0,79)
À recevoir[3]	GBP-SONIO composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053	8 600	247	0,06
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,000	16/06/2031	¥ 50 000	24	0,01
À recevoir	JPY-MUTKCALM composé-OIS à 1 jour	0,450	20/03/2029	154 390	63	0,02
À payer	EURIBOR EUR à 3 mois	0,526	21/11/2023	€ 1 500	(53)	(0,01)
À recevoir[3]	LIBOR USD à 3 mois	1,840	21/11/2028	$ 3 100	255	0,06
À payer[3]	LIBOR USD à 3 mois	1,888	21/11/2053	600	(164)	(0,04)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,000	04/11/2032	€ 1 200	(335)	(0,08)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,000	08/11/2032	1 200	(324)	(0,08)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,190	04/11/2052	200	89	0,02
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,195	04/11/2052	200	101	0,02
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,197	08/11/2052	400	177	0,04
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027	600	(62)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	11/05/2027	300	(31)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027	300	(30)	(0,01)
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	0,830	09/12/2052	4 200	125	0,03
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	600	(53)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	200	(18)	0,00
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	17 300	(276)	(0,07)
À recevoir	CPTFEMU	2,359	15/08/2030	1 400	50	0,01
À recevoir	CPTFEMU	2,470	15/07/2032	1 100	42	0,01
À payer	CPTFEMU	2,590	15/12/2052	500	(6)	0,00
À recevoir	CPTFEMU	2,600	15/05/2032	2 400	87	0,02
À recevoir	CPTFEMU	2,720	15/06/2032	4 200	67	0,02
À recevoir	CPTFEMU	2,965	15/05/2027	10 700	384	0,09
À recevoir	CPTFEMU	2,980	15/06/2027	9 900	190	0,05
À recevoir	CPTFEMU	3,000	15/05/2027	1 900	64	0,02
À recevoir	CPTFEMU	3,130	15/05/2027	2 100	57	0,01
À payer	CPURNSA	1,280	19/05/2030	$ 600	(37)	(0,01)
À recevoir	CPURNSA	1,794	24/08/2027	850	58	0,01
À recevoir	CPURNSA	1,798	25/08/2027	300	21	0,01

Tableau des investissements Fonds Inflation Multi-Asset Fund (suite)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	CPURNSA	1,890 %	27/08/2027	$ 500	$ 35	0,01
À payer	CPURNSA	1,954	03/06/2029	750	(54)	(0,01)
À payer	CPURNSA	2,165	16/04/2029	500	(37)	(0,01)
À recevoir	CPURNSA	2,220	13/04/2023	1 380	106	0,03
À recevoir	CPURNSA	2,263	27/04/2023	80	6	0,00
À recevoir	CPURNSA	2,263	09/05/2023	300	23	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,281	10/05/2023	460	35	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,314	26/02/2026	400	29	0,01
À payer	CPURNSA	2,353	09/05/2028	300	(24)	(0,01)
À payer	CPURNSA	2,360	09/05/2028	450	(36)	(0,01)
À payer	CPURNSA	2,364	10/05/2028	460	(37)	(0,01)
À payer	CPURNSA	2,379	09/07/2028	300	(24)	(0,01)
À recevoir	CPURNSA	2,419	05/03/2026	700	51	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,703	25/05/2026	300	22	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,768	13/05/2026	500	37	0,01
À recevoir	CPURNSA	2,813	14/05/2026	300	22	0,01
À payer	FRCPXTOB	1,280	15/11/2034	€ 200	(45)	(0,01)
À payer	FRCPXTOB	1,590	15/02/2028	180	(32)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,480	15/01/2030	£ 800	(162)	(0,04)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,566	15/03/2036	500	(88)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	3,850	15/09/2024	400	(86)	(0,02)
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,140	15/10/2031	1 900	143	0,03
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,143	15/10/2032	1 400	15	0,00
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,288	15/02/2032	3 200	221	0,05
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,300	15/01/2032	700	54	0,01
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,595	15/08/2032	5 000	(174)	(0,04)
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,615	15/02/2027	4 900	204	0,05
À recevoir	IPC Royaume-Uni	4,735	15/12/2026	400	42	0,01
À recevoir	IPC Royaume-Uni	5,200	15/06/2024	1 300	66	0,02
À recevoir	IPC Royaume-Uni	5,330	15/06/2024	4 000	190	0,05
À recevoir	IPC Royaume-Uni	6,600	15/05/2024	800	40	0,01
					$ (1 914)	(0,47)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ (1 913)**	**(0,47)**

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,410 %	02/02/2023	6 900	$ 34	$ 0	0,00
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,720	23/02/2023	4 800	26	0	0,00
DUB	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,237	17/11/2023	2 300	143	511	0,13
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,200	26/04/2023	8 100	86	5	0,00
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,710	25/01/2023	5 000	31	0	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,428	31/01/2023	7 000	36	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,200	31/05/2023	23 000	276	28	0,01
							$ 632	$ 544	0,14

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente - Indice iTraxx Europe 37 à 5 ans hors cote	Vente	3,000 %	15/03/2023	1 200	$ (2)	$ 0	0,00

OPTIONS PLAFONNÉES SUR L'INFLATION

Contrepartie	Description	Indice initial	Taux variable	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	Taux plafond - CPALEMU hors cote	$ 100,151	Maximum de [(Indice final/Indice initial - 1) - 3,000 %] ou 0	22/06/2035	300	$ (14)	$ (15)	(0,01)

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,558 %	02/02/2023	1 500	$ (34)	$ 0	0,00
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,736	23/02/2023	1 100	(27)	0	0,00
DUB	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,340	17/11/2023	11 200	(141)	(726)	(0,18)
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,350	26/04/2023	4 500	(89)	(8)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547	07/03/2023	1 600	(35)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	1 600	(35)	(101)	(0,02)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	1 900	(22)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	1 900	(26)	(62)	(0,02)
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,785	25/01/2023	1 100	(31)	0	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,579	31/01/2023	1 500	(35)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,350	31/05/2023	12 700	(277)	(37)	(0,01)
							$ (752)	$ (943)	(0,23)

[1] Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17/11/2059	$ 200	$ (6)	$ 6	$ 0	0,00
MYC	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	800	(26)	24	(2)	0,00
SAL	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	200	0	(2)	(2)	0,00
UAG	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	400	(12)	11	(1)	0,00
					$ (44)	$ 39	$ (5)	0,00

[1] Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

[2] Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
MYC	À recevoir	CPURNSA	1,800 %	20/07/2026	$ 600	$ 0	$ (86)	$ (86)	(0,02)
	À recevoir	CPURNSA	1,805	20/09/2026	50	0	(7)	(7)	0,00
	À recevoir	CPURNSA	1,810	19/07/2026	500	0	(72)	(72)	(0,02)
						$ 0	$ (165)	$ (165)	(0,04)

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

Contrepartie	À payer/à recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel	Date d'échéance	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	À recevoir	Indice BCOMF1TC Index	30 040	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	$ 3 267	15/02/2023	$ 0	$ (28)	$ (28)	(0,01)
	À recevoir	Indice BCOMTR Index	138 583	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	34 312	15/02/2023	0	(300)	(300)	(0,07)
	À recevoir	Indice TRNGLU Index	1 133	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	5 096	24/05/2023	0	(17)	(17)	0,00
	À recevoir	Indice TRNGLU Index	2 052	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	9 230	12/07/2023	0	(28)	(28)	(0,01)
BRC	À recevoir	Indice Dow Jones U.S. Select REIT Total Return Index	486	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	5 357	21/06/2023	0	(21)	(21)	(0,01)
CBK	À recevoir	Indice BCOMF1TC Index	21 724	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	2 699	15/02/2023	0	(23)	(23)	(0,01)
	À recevoir	Indice BCOMTR Index	24 694	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	6 114	15/02/2023	0	(53)	(53)	(0,01)
GST	À recevoir	Indice BCOMF1TC Index	7 093	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	2 858	15/02/2023	0	(25)	(25)	(0,01)
	À recevoir	Indice BCOMTR Index	42 761	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	10 587	15/02/2023	0	(93)	(93)	(0,02)
JPM	À recevoir	Indice BCOMF1TC Index	28 657	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	6 040	15/02/2023	0	(53)	(53)	(0,01)
	À recevoir	Indice JMABDEWU Index	16 708	0,053 %	2 589	15/02/2023	0	34	34	0,01

Tableau des investissements Fonds Inflation Multi-Asset Fund (suite)

Contrepartie	À payer/à recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel	Date d'échéance	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
	À recevoir	Indice Dow Jones U.S. Select REIT Total Return Index	447	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	$ 4 927	13/09/2023	$ 0	$ (19)	$ (19)	(0,01)
	À recevoir	Indice JMABNIU5 Index	8 536	0,000	1 514	15/02/2024	0	55	55	0,01
MAC	À recevoir	Indice PIMCODBU Index	45 417	0,160	7 163	15/03/2023	0	192	192	0,05
MYI	À recevoir	Indice Dow Jones U.S. Select REIT Total Return Index	664	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	7 723	04/01/2023	0	(362)	(362)	(0,09)
SOG	À recevoir	Indice BCOMTR Index	22 026	Taux des bons du Trésor américain à 3 mois plus un écart donné	5 453	15/02/2023	0	(48)	(48)	(0,01)
							$ 0	$ (789)	$ (789)	(0,20)

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	AUD	2 513	$	1 702	$ 0	$ (3)	$ (3)	0,00
	01/2023	CZK	6 514		278	0	(10)	(10)	0,00
	01/2023	£	271		329	3	0	3	0,00
	01/2023	$	1 786	HUF	808 299	361	0	361	0,09
	01/2023		119	RON	601	11	0	11	0,00
	01/2023		175	ZAR	3 108	8	0	8	0,00
	02/2023		367		6 582	18	0	18	0,00
BPS	01/2023		901	ILS	3 087	0	(25)	(25)	(0,01)
	01/2023		7	THB	236	0	0	0	0,00
	03/2023	TWD	11 371	$	377	5	0	5	0,00
	03/2023	$	580	CLP	560 527	70	0	70	0,02
	03/2023		942	COP	4 610 549	0	(4)	(4)	0,00
	03/2023		5 088	INR	422 091	0	(12)	(12)	0,00
	03/2023		2 734	MXN	54 988	50	(1)	49	0,01
BRC	01/2023	PLN	1 060	$	211	0	(31)	(31)	(0,01)
	01/2023	$	229	€	215	1	0	1	0,00
	01/2023		2 399	MYR	11 314	189	0	189	0,05
	01/2023		1 365	PHP	76 217	6	0	6	0,00
	01/2023		442	SEK	4 632	2	0	2	0,00
	01/2023		5 547	SGD	7 470	24	0	24	0,01
CBK	01/2023	CLP	1 167 517	$	1 312	0	(57)	(57)	(0,01)
	01/2023	¥	106 400		772	0	(35)	(35)	(0,01)
	01/2023	KRW	739 855		587	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	PLN	1 838		404	0	(15)	(15)	0,00
	01/2023	$	3 373	BRL	17 705	0	(20)	(20)	(0,01)
	01/2023		241	CHF	227	5	0	5	0,00
	01/2023		1 225	CLP	1 167 123	144	0	144	0,04
	01/2023		302	DKK	2 100	0	0	0	0,00
	01/2023		280	€	265	3	0	3	0,00
	02/2023	BRL	1 398	$	259	0	(4)	(4)	0,00
	02/2023	PEN	783		196	0	(8)	(8)	0,00
	02/2023	$	1 312	CLP	1 173 947	58	0	58	0,01
	03/2023		2 494	MXN	48 920	0	(18)	(18)	(0,01)
	03/2023		22	PEN	89	1	0	1	0,00
	05/2023		1	MXN	20	0	0	0	0,00
DUB	01/2023		1 158	TRY	23 693	98	0	98	0,02
	03/2023	MXN	3 810	$	191	0	(2)	(2)	0,00
GLM	01/2023	BRL	16 168		3 034	0	(29)	(29)	(0,01)
	01/2023	$	228	HKD	1 772	0	0	0	0,00
	01/2023		543	MYR	2 403	6	0	6	0,00
	01/2023		4 078	PLN	20 678	632	0	632	0,16
	01/2023		3 101	THB	108 068	24	0	24	0,01
	01/2023		376	ZAR	6 723	19	0	19	0,00
	03/2023	CLP	841 670	$	924	0	(55)	(55)	(0,01)
	03/2023	COP	1 525 581		316	6	0	6	0,00
	03/2023	$	316	COP	1 525 581	0	(6)	(6)	0,00
	03/2023		2 520	MXN	51 804	102	0	102	0,02
	04/2023		2 981	BRL	16 168	29	0	29	0,01
	05/2023		609	PEN	2 426	21	0	21	0,01
	05/2023		55	ZAR	917	0	(2)	(2)	0,00
JPM	01/2023	BRL	1 537	$	285	0	(6)	(6)	0,00
	01/2023	$	2 095	CNY	14 579	17	0	17	0,00
	02/2023		1 590	TWD	48 286	0	(13)	(13)	0,00
	03/2023	MXN	3 810	$	191	0	(2)	(2)	0,00
	03/2023	$	3 762	CNY	26 025	22	0	22	0,01
	03/2023		859	IDR	13 450 001	10	0	10	0,00
MBC	01/2023	AUD	347	$	236	1	0	1	0,00
	01/2023	CAD	1 418		1 057	11	0	11	0,00
	01/2023	DKK	89 230		12 477	0	(335)	(335)	(0,08)
	01/2023	€	28 001		29 320	0	(576)	(576)	(0,14)
	01/2023	£	18 926		23 066	297	0	297	0,07
	01/2023	¥	2 736 000		20 193	0	(556)	(556)	(0,14)
	01/2023	TRY	9 734		500	0	(16)	(16)	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	01/2023	$	945	HKD	7 354	$ 0	$ (2)	$ (2)	0,00
	01/2023		486	¥	63 900	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	MXN	19 605	$	956	0	(43)	(43)	(0,01)
	03/2023	COP	3 084 968		676	48	0	48	0,01
	03/2023	$	521	IDR	8 163 450	6	0	6	0,00
MYI	01/2023	PHP	13 723	$	246	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	1 530	€	1 436	3	0	3	0,00
	01/2023		44	£	36	0	0	0	0,00
	01/2023		301	MYR	1 427	25	0	25	0,01
	02/2023		2 928	TWD	89 271	0	(12)	(12)	0,00
	03/2023		733	IDR	11 502 163	10	0	10	0,00
RBC	01/2023	MYR	1 431	$	314	0	(14)	(14)	0,00
	03/2023	MXN	9 927		496	0	(7)	(7)	0,00
SCX	01/2023	$	6 423	KRW	8 486 953	323	0	323	0,08
	03/2023	INR	1 012	$	12	0	0	0	0,00
SOG	01/2023	$	1 199	RON	6 091	114	0	114	0,03
UAG	01/2023	£	223	$	276	8	0	8	0,00
	01/2023	HUF	91 232		217	0	(25)	(25)	(0,01)
	01/2023	RON	1 099		234	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	$	2 715	CZK	69 037	334	0	334	0,08
	01/2023		1 856	TRY	37 988	158	0	158	0,04
	03/2023		223	ZAR	3 977	10	0	10	0,00
						$ 3 293	$ (1 950)	$ 1 343	0,33

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en AUD (partiellement couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$	76	AUD	112	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
BOA	01/2023		78		116	0	0	0	0,00
CBK	01/2023		2		3	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	KRW	163	$	0	0	0	0	0,00
	01/2023	$	16	AUD	24	0	0	0	0,00
						$ 1	$ 0	$ 1	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (partiellement couverte) de capitalisation, E en EUR (partiellement couverte) de capitalisation et E en EUR (partiellement couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€	356	$	375	$ 0	$ (5)	$ (5)	0,00
BPS	01/2023		394		421	0	0	0	0,00
CBK	01/2023		4 017		4 262	0	(28)	(28)	(0,01)
	01/2023	$	17 090	€	16 457	481	0	481	0,12
MBC	01/2023	€	3 206	$	3 407	0	(16)	(16)	0,00
	01/2023	$	81 631	€	77 894	1 537	0	1 537	0,38
SCX	01/2023		73 026		70 160	1 884	0	1 884	0,47
						$ 3 902	$ (49)	$ 3 853	0,96

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (partiellement couverte) de capitalisation et E en GBP (partiellement couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	134	£	110	$ 0	$ (2)	$ (2)	0,00
BPS	01/2023	£	1	$	2	0	0	0	0,00
BRC	01/2023		15		18	0	0	0	0,00
	01/2023	SGD	3		2	0	0	0	0,00
JPM	01/2023	$	1 311	£	1 086	0	(5)	(5)	0,00
MBC	01/2023		547		452	1	(3)	(2)	0,00
MYI	01/2023	£	51	$	62	2	0	2	0,00
	01/2023	$	49	£	40	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01/2023	KRW	3 096	$	2	0	0	0	0,00
TOR	01/2023	$	1 294	£	1 076	1	0	1	0,00
UAG	01/2023		31		25	0	(1)	(1)	0,00
						$ 4	$ (12)	$ (8)	0,00

Tableau des investissements Fonds Inflation Multi-Asset Fund (suite)

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Administrations en SGD (couverte) de distribution II et E en SGD (partiellement couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 2 490	SGD 3 419	$ 60	$ 0	$ 60	0,01
BPS	01/2023	2 664	3 653	60	0	60	0,01
GLM	01/2023	SGD 11	$ 8	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 15	SGD 21	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	SGD 48	$ 36	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 1 136	SGD 1 553	22	0	22	0,01
SCX	01/2023	SGD 17	$ 13	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	339	248	0	(5)	(5)	0,00
				$ 142	$ (5)	$ 137	0,03

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ 3 953**	**0,98**
Total des Investissements	**$ 433 837**	**107,63**
Autres actifs et passifs à court terme	**$ (30 759)**	**(7,63)**
Actif net	**$ 403 078**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

(e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(f) Affilié au Fonds.

Un montant en numéraire de 5 919 $ (31 décembre 2021 : 2 100 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 2 260 $ (31 décembre 2021 : 260 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 8 543	$ 311 578	$ 0	$ 320 121
Fonds d'investissement	68 975	0	0	68 975
Contrats de mise en pension	0	40 720	0	40 720
Instruments financiers dérivés[3]	1 933	2 088	0	4 021
Totaux	**$ 79 451**	**$ 354 386**	**$ 0**	**$ 433 837**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 20 179	$ 122 440	$ 0	$ 142 619
Fonds d'investissement	12 603	7 844	0	20 447
Contrats de mise en pension	0	500	0	500
Instruments financiers dérivés[3]	519	(138)	0	381
Totaux	**$ 33 301**	**$ 130 646**	**$ 0**	**$ 163 947**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ 1	$ 0	$ 1	$ S/O	$ S/O	$ S/O
BOA	441	(240)	201	62	0	62
BPS	(230)	620	390	538	(280)	258
BRC	170	170	340	45	0	45
CBK	430	(240)	190	175	(260)	(85)
DUB	(119)	0	(119)	(2)	0	(2)
FAR	S/O	S/O	S/O	(1)	0	(1)
FBF	S/O	S/O	S/O	15	0	15
GLM	557	(550)	7	(10)	(280)	(290)
GST	(118)	260	142	90	0	90
HUS	S/O	S/O	S/O	(59)	0	(59)
IND	S/O	S/O	S/O	3	0	3
JPM	40	400	440	402	(330)	72
MAC	192	0	192	4	0	4
MBC	375	(200)	175	S/O	S/O	S/O
MYC	(176)	260	84	(139)	0	(139)
MYI	(336)	550	214	193	(260)	(67)
RBC	(21)	0	(21)	9	0	9
RYL	S/O	S/O	S/O	11	0	11
SAL	(2)	0	(2)	(6)	0	(6)
SCX	2 207	(260)	1 947	337	(280)	57
SOG	66	0	66	39	260	299
SSB	S/O	S/O	S/O	76	0	76
TOR	1	0	1	89	0	89
UAG	475	(530)	(55)	32	(270)	(238)

[1] L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	53,86	80,61
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	24,35	5,58
Autres valeurs mobilières	1,21	0,60
Fonds d'investissement	17,11	12,44
Contrats de mise en pension	10,10	0,30
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,49	0,23
Instruments financiers dérivés compensés	(0,47)	(1,16)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,98	1,16

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Obligations et billets privés	3,02	9,40
Agences du gouvernement américain	10,47	2,73
Obligations du Trésor américain	29,26	25,38
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	4,06	1,28
Titres adossés à des actifs	3,00	1,81
Émissions souveraines	20,01	33,33
Actions ordinaires	0,37	6,22
Titres privilégiés	0,14	0,58
Sociétés d'investissement immobilier	1,75	6,06
Instruments à court terme	7,34	S/O
Fonds d'investissement	17,11	12,44
Contrats de mise en pension	10,10	0,30
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,49	0,23
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(0,47)	(1,16)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,14	0,14
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Options plafonnées sur l'inflation	(0,01)	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,23)	(0,15)
Options sur titres	S/O	(0,01)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,00	0,01
Swaps de taux d'intérêt	(0,04)	(0,09)
Swaps de rendement total sur indices	(0,20)	0,47
Swaps de rendement total sur titres	S/O	0,09
Contrats de change à terme	0,33	0,22
Contrats de change à terme couverts	0,99	0,48
Autres actifs et passifs à court terme	(7,63)	0,24
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Low Average Duration Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				
ABN AMRO Bank NV				
2,375 % éch. 01/06/2027	€	3 600	$ 3 606	0,34
American Tower Corp.				
3,000 % éch. 15/06/2023	$	3 560	3 523	0,33
Banque de développement asiatique				
6,550 % éch. 26/01/2025	ZAR	46 000	2 635	0,25
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
0,875 % éch. 18/09/2023	$	2 400	2 325	0,22
Banco de Sabadell S.A.				
2,625 % éch. 24/03/2026	€	3 500	3 515	0,33
Banco Santander S.A.				
3,892 % éch. 24/05/2024	$	3 600	3 526	0,33
Bank of America Corp.				
3,081 % éch. 22/09/2026	€	2 400	2 527	0,24
5,285 % éch. 23/07/2024	$	3 500	3 501	0,33
Barclays PLC				
5,304 % éch. 09/08/2026		3 500	3 477	0,32
7,325 % éch. 02/11/2026		1 400	1 452	0,14
BNP Paribas S.A.				
4,705 % éch. 10/01/2025		2 300	2 278	0,21
Capital One Financial Corp.				
4,166 % éch. 09/05/2025		4 000	3 909	0,36
4,985 % éch. 24/07/2026		3 800	3 725	0,35
Citigroup, Inc.				
4,615 % éch. 25/01/2026 (f)		2 900	2 836	0,26
Corsair International Ltd.				
5,473 % éch. 28/01/2027	€	2 600	2 754	0,26
CPI Property Group S.A.				
2,750 % éch. 12/05/2026		2 200	1 849	0,17
Crédit Agricole S.A.				
5,345 % éch. 24/04/2023	$	4 450	4 454	0,41
Credit Suisse AG				
3,700 % éch. 21/02/2025		4 000	3 691	0,34
Credit Suisse Group AG				
2,193 % éch. 05/06/2026		2 400	2 052	0,19
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % éch. 19/11/2025	€	1 975	1 704	0,16
CTP NV				
0,500 % éch. 21/06/2025		2 300	2 061	0,19
Danske Bank A/S				
3,773 % éch. 28/03/2025	$	4 000	3 878	0,36
Deutsche Bank AG				
1,000 % éch. 19/11/2025	€	3 000	2 992	0,28
3,961 % éch. 26/11/2025	$	4 000	3 825	0,36
4,603 % éch. 08/11/2023		2 800	2 782	0,26
5,374 % éch. 16/11/2027		1 500	1 343	0,13
6,119 % éch. 14/07/2026		4 000	3 977	0,37
Equinix, Inc.				
2,625 % éch. 18/11/2024		3 400	3 240	0,30
Equitable Holdings, Inc.				
3,900 % éch. 20/04/2023		52	52	0,00
GA Global Funding Trust				
1,250 % éch. 08/12/2023		3 400	3 264	0,30
3,850 % éch. 11/04/2025		3 500	3 353	0,31
Goldman Sachs Group, Inc.				
1,757 % éch. 24/01/2025		1 800	1 724	0,16
3,000 % éch. 15/03/2024		3 300	3 219	0,30
HSBC Holdings PLC				
2,999 % éch. 10/03/2026		3 600	3 387	0,32
ING Groep NV				
3,869 % éch. 28/03/2026		4 000	3 852	0,36
JPMorgan Chase & Co.				
1,514 % éch. 01/06/2024		2 800	2 755	0,26
4,851 % éch. 25/07/2028		4 300	4 199	0,39
Manulife Financial Corp.				
4,150 % éch. 04/03/2026		1 500	1 463	0,14
Mizuho Financial Group, Inc.				
4,362 % éch. 19/07/2023	AUD	4 800	3 259	0,30
4,899 % éch. 10/07/2024	$	3 100	3 093	0,29
5,414 % éch. 13/09/2028		2 800	2 805	0,26
Morgan Stanley				
6,138 % éch. 16/10/2026		2 700	2 761	0,26
NatWest Group PLC				
7,472 % éch. 10/11/2026	$	1 300	$ 1 354	0,13
NatWest Markets PLC				
3,479 % éch. 22/03/2025		4 000	3 828	0,36
NTT Finance Corp.				
0,373 % éch. 03/03/2023		3 000	2 983	0,28
Pricoa Global Funding				
4,200 % éch. 28/08/2025		2 700	2 649	0,25
Santander Holdings USA, Inc.				
3,450 % éch. 02/06/2025		2 700	2 575	0,24
Santander UK Group Holdings PLC				
6,833 % éch. 21/11/2026		2 300	2 332	0,22
SOCAR Turkey Enerji AS Via Steas Funding DAC				
7,230 % éch. 17/03/2026		4 000	3 910	0,36
Société Générale S.A.				
2,625 % éch. 22/01/2025		2 500	2 352	0,22
Standard Chartered PLC				
1,822 % éch. 23/11/2025		2 600	2 377	0,22
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
0,800 % éch. 12/09/2023		3 100	3 008	0,28
Swedbank AB				
3,356 % éch. 04/04/2025		4 000	3 848	0,36
Toyota Motor Credit Corp.				
5,050 % éch. 11/12/2023		800	801	0,07
UBS Group AG				
4,125 % éch. 24/09/2025		800	779	0,07
4,488 % éch. 12/05/2026		4 000	3 913	0,36
4,703 % éch. 05/08/2027		1 600	1 549	0,14
UniCredit SpA				
7,830 % éch. 04/12/2023		6 350	6 417	0,60
Volkswagen Financial Services NV				
1,125 % éch. 18/09/2023	£	600	704	0,07
Wells Fargo & Co.				
2,125 % éch. 20/12/2023		900	1 056	0,10
3,908 % éch. 25/04/2026	$	2 700	2 627	0,24
4,808 % éch. 25/07/2028		4 000	3 913	0,36
			175 598	16,37
INDUSTRIE				
7-Eleven, Inc.				
0,625 % éch. 10/02/2023		2 900	2 885	0,27
ASTM SpA				
1,000 % éch. 25/11/2026	€	2 500	2 289	0,21
Boeing Co.				
1,167 % éch. 04/02/2023	$	3 500	3 487	0,33
1,950 % éch. 01/02/2024		3 500	3 373	0,32
CenterPoint Energy Resources Corp.				
5,279 % éch. 02/03/2023		1 725	1 724	0,16
Chanel Ceres PLC				
0,500 % éch. 31/07/2026	€	2 800	2 693	0,25
Comcast Corp.				
5,250 % éch. 07/11/2025	$	1 100	1 116	0,10
CommonSpirit Health				
1,547 % éch. 01/10/2025		2 900	2 610	0,24
Continental Resources, Inc.				
2,268 % éch. 15/11/2026		2 900	2 517	0,24
CRH America, Inc.				
3,875 % éch. 18/05/2025		2 700	2 607	0,24
Daimler Trucks Finance North America LLC				
1,125 % éch. 14/12/2023		3 000	2 883	0,27
4,779 % éch. 14/06/2023		3 300	3 296	0,31
4,918 % éch. 14/12/2023		3 000	2 982	0,28
5,062 % éch. 13/12/2024		2 800	2 763	0,26
Danone S.A.				
2,947 % éch. 02/11/2026		2 400	2 234	0,21
Dell International LLC				
5,450 % éch. 15/06/2023		240	240	0,02
Elevance Health, Inc.				
3,350 % éch. 01/12/2024		1 000	970	0,09
Expedia Group, Inc.				
5,000 % éch. 15/02/2026		3 393	3 352	0,31
Fidelity National Information Services, Inc.				
0,375 % éch. 01/03/2023		3 000	2 978	0,28
Global Payments, Inc.				
4,950 % éch. 15/08/2027		3 800	3 692	0,34
Hyundai Capital America				
1,000 % éch. 17/09/2024	$	3 000	$ 2 774	0,26
Illumina, Inc.				
5,800 % éch. 12/12/2025		1 500	1 512	0,14
Mercedes-Benz Finance North America LLC				
5,500 % éch. 27/11/2024		3 900	3 925	0,37
Nissan Motor Co. Ltd.				
3,043 % éch. 15/09/2023		3 600	3 528	0,33
NXP BV				
4,875 % éch. 01/03/2024		2 700	2 681	0,25
Penske Truck Leasing Co. LP				
1,700 % éch. 15/06/2026		3 300	2 891	0,27
Philip Morris International, Inc.				
5,125 % éch. 15/11/2024		3 900	3 908	0,36
Reliance Steel & Aluminum Co.				
1,300 % éch. 15/08/2025		3 900	3 528	0,33
Renesas Electronics Corp.				
2,170 % éch. 25/11/2026		2 800	2 403	0,22
SK Hynix, Inc.				
1,000 % éch. 19/01/2024		2 900	2 756	0,26
Southern Co.				
3,250 % éch. 01/07/2026		2 100	1 977	0,18
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.				
3,900 % éch. 22/03/2023		500	499	0,05
TD SYNNEX Corp.				
1,250 % éch. 09/08/2024		4 300	3 996	0,37
VMware, Inc.				
1,000 % éch. 15/08/2024		2 700	2 514	0,23
Volkswagen Group of America Finance LLC				
3,125 % éch. 12/05/2023		3 300	3 274	0,31
WRKCo, Inc.				
3,750 % éch. 15/03/2025		2 700	2 614	0,24
			95 471	8,90
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
AES Corp.				
1,375 % éch. 15/01/2026		3 200	2 845	0,26
Atmos Energy Corp.				
5,103 % éch. 09/03/2023		3 600	3 598	0,34
Constellation Energy Generation LLC				
3,250 % éch. 01/06/2025		2 600	2 490	0,23
Enel Finance International NV				
2,650 % éch. 10/09/2024		4 000	3 830	0,36
6,800 % éch. 14/10/2025		1 900	1 953	0,18
Eversource Energy				
0,800 % éch. 15/08/2025		3 000	2 691	0,25
Pacific Gas & Electric Co.				
3,150 % éch. 01/01/2026		3 300	3 070	0,29
3,400 % éch. 15/08/2024 ^		500	480	0,04
3,850 % éch. 15/11/2023 ^		1 000	986	0,09
4,250 % éch. 01/08/2023		3 100	3 085	0,29
4,950 % éch. 08/06/2025		2 500	2 464	0,23
SSE PLC				
1,250 % éch. 16/04/2025	€	2 200	2 222	0,21
			29 714	2,77
Total des Obligations et billets privés			300 783	28,04
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Fannie Mae				
0,000 % éch. 25/04/2040 (a)(c)	$	138	106	0,01
1,000 % éch. 25/01/2043		57	48	0,01
1,978 % éch. 01/01/2035		16	16	0,00
2,022 % éch. 01/01/2035		3	3	0,00
2,276 % éch. 01/12/2034		14	14	0,00
2,550 % éch. 01/03/2035		1	1	0,00
2,888 % éch. 01/06/2043		21	20	0,00
2,889 % éch. 01/07/2042		19	18	0,00
2,939 % éch. 01/09/2041		48	46	0,01
3,153 % éch. 01/12/2034		3	3	0,00
3,462 % éch. 01/05/2038		608	617	0,06
3,647 % éch. 01/01/2035		5	5	0,00
3,821 % éch. 25/07/2037		17	17	0,00
3,952 % éch. 01/07/2035		2	2	0,00
3,971 % éch. 01/08/2035		100	102	0,01
4,739 % éch. 25/12/2036 - 25/03/2044		1 552	1 523	0,14

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,799 % éch. 25/09/2035	$	132	$ 130	0,01
Freddie Mac				
0,000 % éch. 15/05/2037 (a)(c)		50	44	0,00
0,650 % éch. 22/10/2025		23 500	21 041	1,96
0,680 % éch. 06/08/2025		11 300	10 208	0,95
0,800 % éch. 28/10/2026		7 000	6 103	0,57
2,000 % éch. 15/11/2026		1 069	1 045	0,10
2,150 % éch. 01/01/2035		5	5	0,00
2,206 % éch. 01/12/2034		3	3	0,00
2,802 % éch. 01/01/2035		3	3	0,00
2,889 % éch. 25/02/2045		66	67	0,01
3,491 % éch. 01/07/2035		8	8	0,00
4,021 % éch. 01/09/2035		66	66	0,01
4,472 % éch. 25/09/2024		977	972	0,09
4,632 % éch. 25/07/2026		321	319	0,03
4,638 % éch. 15/02/2037		18	18	0,00
4,642 % éch. 25/10/2026		353	352	0,03
4,768 % éch. 15/09/2041		4	4	0,00
6,500 % éch. 25/07/2043		80	83	0,01
Ginnie Mae				
1,000 % éch. 20/01/2073		800	801	0,08
3,000 % éch. 20/06/2027		10	10	0,00
3,547 % éch. 20/04/2066		2 004	1 980	0,19
3,575 % éch. 20/07/2067		5 545	5 518	0,52
3,603 % éch. 20/06/2065		1 182	1 174	0,11
4,542 % éch. 20/10/2065		13	13	0,00
4,564 % éch. 20/08/2070		2 585	2 596	0,24
4,576 % éch. 20/10/2072		2 266	2 261	0,21
4,642 % éch. 20/05/2066		1 237	1 222	0,11
4,854 % éch. 20/02/2062		17	17	0,00
4,986 % éch. 20/11/2072		8 301	8 394	0,78
4,996 % éch. 20/11/2072		9 420	9 532	0,89
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)				
3,000 % éch. 01/02/2052		18 541	16 324	1,52
3,500 % éch. 01/07/2047		31 076	28 836	2,69
4,000 % éch. 01/10/2047		21	20	0,00
5,000 % éch. 01/02/2025 - 01/10/2031		673	674	0,06
6,000 % éch. 01/12/2023 - 01/01/2041		961	1 001	0,09
6,500 % éch. 01/12/2035 - 01/01/2036		9	9	0,00
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				
4,000 % éch. 01/02/2053		67 900	63 719	5,94
4,500 % éch. 01/02/2053		56 300	54 199	5,05
5,000 % éch. 01/01/2053		5 400	5 322	0,50
			246 634	22,99
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Billets du Trésor américain				
0,875 % éch. 31/01/2024 (g)		244 100	234 327	21,84
1,500 % éch. 29/02/2024 (h)		190 000	183 228	17,08
2,875 % éch. 15/05/2032 (g)		1 800	1 659	0,16
4,375 % éch. 31/10/2024 (g)		88 200	87 955	8,20
			507 169	47,28
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Avon Finance PLC				
4,331 % éch. 20/09/2048	£	1 771	2 090	0,20
Banc of America Mortgage Trust				
3,679 % éch. 25/07/2034	$	13	12	0,00
3,961 % éch. 25/08/2034		253	246	0,02
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust				
5,293 % éch. 15/08/2036		4 600	4 523	0,42
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,830 % éch. 25/01/2034		7	6	0,00
3,844 % éch. 25/07/2034		124	109	0,01
4,960 % éch. 25/01/2035		7	6	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,811 % éch. 25/12/2033		28	27	0,00
4,709 % éch. 25/02/2034		52	46	0,00
Citigroup Global Markets Mortgage Securities, Inc.				
7,000 % éch. 25/12/2018		1	1	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust				
5,410 % éch. 25/10/2035		15	14	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust				
6,000 % éch. 25/10/2033		10	9	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
3,671 % éch. 20/02/2035	$	8	$ 8	0,00
3,792 % éch. 25/11/2034		33	29	0,00
DBGS Mortgage Trust				
5,113 % éch. 15/06/2033		2 800	2 677	0,25
Eurosail PLC				
4,461 % éch. 13/06/2045	£	4 477	5 293	0,49
FirstMac Mortgage Funding Trust				
4,056 % éch. 08/03/2049	AUD	788	534	0,05
4,306 % éch. 08/03/2049		8 000	5 427	0,51
Formentera Issuer PLC				
3,844 % éch. 28/07/2047	£	2 753	3 264	0,30
Great Hall Mortgages PLC				
4,868 % éch. 18/06/2039	$	495	486	0,05
GSR Mortgage Loan Trust				
3,767 % éch. 25/09/2035		80	75	0,01
6,000 % éch. 25/03/2032		0	0	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust				
4,869 % éch. 25/04/2035		284	235	0,02
Morgan Stanley Capital Trust				
5,218 % éch. 15/07/2035		4 260	4 179	0,39
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
3,787 % éch. 25/10/2034		322	305	0,03
MortgageIT Trust				
5,029 % éch. 25/02/2035		66	64	0,01
Opteum Mortgage Acceptance Corp. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
4,949 % éch. 25/12/2035		290	265	0,03
Pepper Residential Securities Trust				
4,210 % éch. 16/09/2059	AUD	1 250	844	0,08
Prime Mortgage Trust				
4,789 % éch. 25/02/2034	$	2	2	0,00
Primrose Residential DAC				
2,644 % éch. 24/03/2061	€	3 030	3 158	0,29
Ripon Mortgages PLC				
4,011 % éch. 28/08/2056	£	4 995	5 897	0,55
Sequoia Mortgage Trust				
4,773 % éch. 20/06/2036	$	246	227	0,02
5,153 % éch. 20/10/2027		2	1	0,00
Stratton Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2060	£	3 100	3 697	0,34
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,565 % éch. 25/01/2035	$	129	127	0,01
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
4,839 % éch. 19/07/2035		16	14	0,00
Thornburg Mortgage Securities Trust				
5,069 % éch. 25/04/2043		0	0	0,00
Towd Point Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2045	£	5 105	6 075	0,57
4,071 % éch. 20/10/2051		2 727	3 261	0,30
4,171 % éch. 20/05/2045		5 499	6 516	0,61
Trinity Square PLC				
3,729 % éch. 15/07/2059		2 304	2 740	0,26
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,448 % éch. 25/06/2042	$	4	4	0,00
5,069 % éch. 25/01/2045		451	415	0,04
Warwick Finance Residential Mortgages PLC				
4,387 % éch. 21/12/2049	£	1 047	1 259	0,12
Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust				
3,995 % éch. 15/05/2047	$	4 300	4 190	0,39
			68 357	6,37
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,409 % éch. 25/10/2034		1 266	1 244	0,12
Ares European CLO DAC				
2,306 % éch. 20/04/2032	€	3 100	3 214	0,30
Avoca CLO DAC				
2,198 % éch. 15/10/2032		3 000	3 100	0,29
Barings Euro CLO DAC				
2,778 % éch. 25/11/2029		1 614	1 697	0,16
Black Diamond CLO DAC				
2,778 % éch. 15/05/2032		2 700	2 794	0,26

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				
2,098 % éch. 15/01/2031	€	2 399	$ 2 491	0,23
BNPP AM Euro CLO DAC				
2,322 % éch. 22/07/2032		3 000	3 103	0,29
Bridgepoint CLO DAC				
2,588 % éch. 15/01/2034		3 400	3 551	0,33
Cairn CLO DAC				
2,688 % éch. 20/10/2028		725	758	0,07
Carbone CLO Ltd.				
5,383 % éch. 20/01/2031	$	3 630	3 581	0,33
Carlyle Euro CLO DAC				
2,078 % éch. 15/01/2031	€	2 199	2 290	0,21
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
2,548 % éch. 15/11/2031		2 600	2 689	0,25
Catamaran CLO Ltd.				
5,425 % éch. 22/04/2030	$	3 482	3 432	0,32
CBAM CLO Ltd.				
5,099 % éch. 17/04/2031		500	491	0,05
CIFC Funding Ltd.				
5,259 % éch. 16/11/2030		2 250	2 229	0,21
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
5,439 % éch. 25/11/2034		510	503	0,05
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
4,598 % éch. 25/01/2032		7	7	0,00
Fortress Investment Group LLC				
5,761 % éch. 23/02/2039		7 200	6 934	0,65
Gallatin CLO Ltd.				
5,328 % éch. 21/01/2028		1 807	1 792	0,17
GoldenTree Loan Management EUR CLO DAC				
2,356 % éch. 20/01/2032	€	2 500	2 580	0,24
GoldenTree Loan Opportunities Ltd.				
5,363 % éch. 20/07/2031	$	2 650	2 619	0,24
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				
5,498 % éch. 15/09/2037		2 091	2 059	0,19
Griffith Park CLO DAC				
2,522 % éch. 21/11/2031	€	3 000	3 100	0,29
Harvest CLO DAC				
2,775 % éch. 26/06/2030		2 895	3 021	0,28
Jubilee CLO DAC				
1,988 % éch. 15/04/2030		4 000	4 173	0,39
Madison Park Euro Funding DAC				
2,128 % éch. 15/01/2032		2 700	2 790	0,26
Marble Point CLO Ltd.				
5,374 % éch. 18/12/2030	$	3 600	3 531	0,33
Nassau Ltd.				
5,229 % éch. 15/10/2029		2 527	2 495	0,23
OCP Euro CLO DAC				
0,000 % éch. 20/01/2033 (b)	€	2 000	2 124	0,20
Octagon Loan Funding Ltd.				
5,854 % éch. 18/11/2031	$	3 400	3 353	0,31
Palmer Square European Loan Funding DAC				
2,098 % éch. 15/10/2031	€	2 640	2 733	0,25
2,108 % éch. 15/07/2031		2 278	2 367	0,22
Saranac CLO Ltd.				
6,353 % éch. 22/06/2030	$	3 478	3 429	0,32
SLM Student Loan Trust				
4,508 % éch. 25/10/2029		816	810	0,07
Structured Asset Investment Loan Trust				
5,364 % éch. 25/10/2033		19	19	0,00
TICP CLO Ltd.				
5,083 % éch. 20/04/2028		921	919	0,09
Tikehau CLO DAC				
2,596 % éch. 04/08/2034	€	2 300	2 383	0,22
Toro European CLO DAC				
2,239 % éch. 12/01/2032		2 500	2 570	0,24
2,572 % éch. 15/02/2034		3 200	3 294	0,31
Venture CLO Ltd.				
5,343 % éch. 20/01/2029	$	2 802	2 770	0,26
			99 039	9,23
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BONS DU TRÉSOR HONGROIS				
18,250 % éch. 03/01/2023 (c)(d)	HUF	1 152 000	3 070	0,29

Tableau des investissements Fonds Low Average Duration Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN				
0,020 % éch. 04/01/2023 (c)(d)	ILS	9 000	2 550	0,24
0,788 % éch. 02/03/2023 (c)(d)		13 000	3 663	0,34
0,886 % éch. 03/05/2023 (c)(d)		15 500	4 341	0,40
			10 554	0,98
Total des Instruments à court terme			13 624	1,27
Total des Valeurs mobilières			**$ 1 235 606**	**115,18**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds US Short-Term Fund (e)	3 225 365	$ 32 189	3,00
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	545 394	5 429	0,51
		37 618	3,51

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (e)	484 660	$ 48 013	4,47
Total des Fonds d'investissement		**$ 85 631**	**7,98**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
FICC	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 956	Billets du Trésor américain 0,125 % échéance 15/05/2023	$ (975)	$ 956	$ 956	0,09
Total des Contrats de mise en pension						**$ (975)**	**$ 956**	**$ 956**	**0,09**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Court	03/2023	265	$ 959	0,09
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Long	03/2023	33	(302)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Court	03/2023	42	847	0,08
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Long	03/2023	1 530	189	0,02
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	355	(48)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Court	03/2023	373	113	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	261	47	0,00
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Court	03/2023	58	456	0,04
				$ 2 261	0,21
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ 2 261**	**0,21**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000 %	20/12/2024	$ 1 000	$ 0	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION[2]

Indices/Tranches	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.HY-38 à 5 ans	(5,000) %	20/06/2027	$ 22 770	$ (636)	(0,06)
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	(1,000)	20/12/2027	132 000	(154)	(0,01)
				$ (790)	(0,07)

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000 %	17/03/2024	¥ 5 680 000	$ (141)	(0,01)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,380	18/06/2028	90 000	(23)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2032	$ 11 700	321	0,03
À recevoir[4]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	4,270	13/09/2024	5 000	7	0,00
À recevoir[4]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	4,350	14/09/2024	3 200	2	0,00

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel		Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer[4]	BBR NZD à 3 mois	4,000 %	14/06/2024	NZD	279 100	$ (2 064)	(0,19)
À payer[4]	BBR NZD à 3 mois	4,500	13/09/2024		8 800	(51)	(0,01)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,580	24/05/2024	€	144 500	(3 167)	(0,30)
						$ (5 116)	(0,48)
Total des Instruments financiers dérivés compensés						**$ (5 906)**	**(0,55)**

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,750 %	12/09/2023	12 600	$ 101	$ 102	0,01
FAR	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,750	11/09/2023	11 800	89	96	0,01
MYC	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,750	11/09/2023	10 700	81	87	0,01
							$ 271	$ 285	0,03

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,250 %	12/09/2023	12 600	$ (63)	$ (64)	(0,01)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,750	12/09/2023	12 600	(38)	(36)	0,00
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,150	09/01/2023	20 500	(72)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	09/01/2023	20 500	(72)	(124)	(0,01)
FAR	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,233	11/09/2023	11 800	(56)	(61)	(0,01)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,715	11/09/2023	11 800	(33)	(35)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	26 600	(193)	(41)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,088	03/11/2023	26 600	(193)	(317)	(0,03)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	40 700	(148)	(28)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	40 700	(148)	(291)	(0,03)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	14 800	(46)	(12)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	14 800	(46)	(102)	(0,01)
MYC	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,233	11/09/2023	10 700	(51)	(55)	(0,01)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,715	11/09/2023	10 700	(30)	(32)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,993	11/10/2023	53 500	(361)	(71)	(0,01)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,993	11/10/2023	53 500	(361)	(725)	(0,07)
							$ (1 911)	$ (1 994)	(0,19)

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	$ 99,813	06/02/2023	1 200	$ (8)	$ (7)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	101,813	06/02/2023	1 200	(7)	(3)	0,00
SAL	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	101,859	05/01/2023	1 500	(5)	0	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	102,250	05/01/2023	1 100	(3)	0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	100,000	06/02/2023	500	(4)	(3)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	102,000	06/02/2023	500	(3)	(1)	0,00
					$ (30)	$ (14)	0,00

(1) Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000 %	20/12/2026	$ 2 000	$ (94)	$ 17	$ (77)	(0,01)
CBK	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2026	5 600	(270)	53	(217)	(0,02)
MYC	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	1 900	(108)	(5)	(113)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	2 300	(205)	38	(167)	(0,02)
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2026	4 200	(195)	32	(163)	(0,01)
					$ (872)	$ 135	$ (737)	(0,07)

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	HUF	39 173	$	100	$ 0	$ (4)	$ (4)	0,00
	01/2023	$	1 429	AUD	2 110	2	0	2	0,00
	01/2023		178	ZAR	3 161	8	0	8	0,00
	02/2023	€	1 698	$	1 799	0	(18)	(18)	0,00
	02/2023	£	36 469		43 033	0	(885)	(885)	(0,08)
	02/2023	¥	63 500		462	0	(22)	(22)	0,00
	03/2023	ZAR	128 091		7 254	0	(230)	(230)	(0,02)
BPS	01/2023	HUF	285 055		749	0	(11)	(11)	0,00
	02/2023	€	82 883		85 945	0	(2 767)	(2 767)	(0,26)
	03/2023	MXN	1 089		54	0	(1)	(1)	0,00
BRC	02/2023	$	655	€	632	22	0	22	0,00
	02/2023		1 016	£	832	0	(14)	(14)	0,00
CBK	01/2023	ILS	8 998	$	2 848	298	0	298	0,03
	01/2023	$	5 504	BRL	28 885	0	(33)	(33)	0,00
	01/2023		412	ZAR	7 219	11	0	11	0,00
	02/2023	BRL	3 245	$	601	0	(10)	(10)	0,00
	02/2023	€	98		105	0	0	0	0,00
	02/2023	NZD	3 083		1 870	0	(81)	(81)	(0,01)
	02/2023	PEN	22 466		5 586	0	(277)	(277)	(0,03)
	02/2023	$	2 738	PEN	10 990	134	0	134	0,01
	03/2023	ILS	12 934	$	3 921	244	0	244	0,02
	03/2023	$	100	PEN	393	2	0	2	0,00
	04/2023		757		3 030	30	0	30	0,00
	05/2023	ILS	15 370	$	4 658	270	0	270	0,02
CLY	01/2023	HUF	182 434		464	0	(22)	(22)	0,00
GLM	01/2023	BRL	28 885		5 420	0	(51)	(51)	0,00
	01/2023	CNH	169		24	0	0	0	0,00
	01/2023	HUF	110 387		283	0	(12)	(12)	0,00
	04/2023	$	5 325	BRL	28 885	52	0	52	0,00
JPM	01/2023	HUF	7 829	$	20	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	793	CNY	5 516	6	0	6	0,00
	03/2023		1 423		9 848	8	0	8	0,00
MBC	01/2023	AUD	486	$	326	0	(4)	(4)	0,00
	02/2023	£	46		55	0	0	0	0,00
	02/2023	$	2 513	€	2 385	40	0	40	0,00
	03/2023		6 863	ZAR	128 091	622	0	622	0,06
	05/2023	CNH	23 846	$	3 553	73	0	73	0,01
MYI	01/2023	AUD	15 399		10 341	0	(104)	(104)	(0,01)
	01/2023	€	24		26	0	0	0	0,00
	01/2023	$	13	£	11	0	0	0	0,00
RBC	01/2023	AUD	177	$	119	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01/2023		1 033		696	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	$	1 725	PEN	6 926	88	0	88	0,01
	02/2023	NZD	798	$	485	0	(20)	(20)	0,00
	04/2023	ZAR	107 762		5 858	0	(423)	(423)	(0,04)
UAG	01/2023	HUF	531 467		1 386	0	(31)	(31)	0,00
	02/2023	$	2 183	ZAR	40 667	199	0	199	0,02
	03/2023		226		4 045	10	0	10	0,00
	05/2023		3 395	CNH	23 527	38	0	38	0,00
						$ 2 157	$ (5 027)	$ (2 870)	(0,27)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	11	€	10	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BPS	01/2023	€	238	$	254	0	0	0	0,00
	01/2023	$	379	€	355	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	€	48	$	51	0	0	0	0,00
	01/2023	$	22 385	€	21 579	656	0	656	0,06
JPM	01/2023		4 291		4 127	115	0	115	0,01
MBC	01/2023	€	1 071	$	1 133	0	(11)	(11)	0,00
	01/2023	$	24 359	€	23 236	451	0	451	0,05
SCX	01/2023		24 703		23 733	637	0	637	0,06
						$ 1 859	$ (11)	$ 1 848	0,18

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£	38	$	46	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	01/2023	$	37	£	31	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	£	11	$	13	0	0	0	0,00
JPM	01/2023	$	8 130	£	6 733	0	(31)	(31)	0,00
MBC	01/2023		8 167		6 816	35	(2)	33	0,00
MYI	01/2023	£	37	$	46	1	0	1	0,00
TOR	01/2023	$	8 105	£	6 741	5	0	5	0,00
UAG	01/2023		33		26	0	(1)	(1)	0,00
						$ 42	$ (34)	$ 8	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ (3 474)**	**(0,32)**

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
3,000 % éch. 01/02/2053	$ 55 500	$ (48 764)	(4,54)
3,500 % éch. 01/02/2053	31 000	(28 185)	(2,63)
Total des Titres vendus à découvert		**$ (76 949)**	**(7,17)**
Total des Investissements		**$ 1 238 125**	**115,42**
Autres actifs et passifs à court terme		**$ (165 367)**	**(15,42)**
Actif net		**$ 1 072 758**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* **Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

^ **Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.**

(a) Titre à principal uniquement.

(b) Titre vendu avant l'émission.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,12 %) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Citigroup, Inc.	4,615 %	25/01/2026	18/01/2022	$ 2 900	$ 2 836	0,26

(g) Des titres d'une juste valeur globale de 143 852 $ (31 décembre 2021 : 0 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 4 050 $ (31 décembre 2021 : 0 $) ont été nantis ou livrés en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 16 925 $ (31 décembre 2021 : 8 162 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 1 227 $) et un montant en numéraire de 5 301 $ (31 décembre 2021 : 20 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Tableau des investissements Fonds Low Average Duration Fund (suite)

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 1 234 805	$ 801	$ 1 235 606
Fonds d'investissement	37 618	48 013	0	85 631
Contrats de mise en pension	0	956	0	956
Instruments financiers dérivés[3]	1 960	(9 079)	0	(7 119)
Titres vendus à découvert	0	(76 949)	0	(76 949)
Totaux	**$ 39 578**	**$ 1 197 746**	**$ 801**	**$ 1 238 125**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 1 057 626	$ 0	$ 1 057 626
Fonds d'investissement	113 421	0	0	113 421
Contrats de mise en pension	0	24 177	0	24 177
Instruments financiers dérivés[3]	444	(3 896)	0	(3 452)
Titres vendus à découvert	0	(38 058)	0	(38 058)
Totaux	**$ 113 865**	**$ 1 039 849**	**$ 0**	**$ 1 153 714**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	En % de l'actif net
BOS	4,340 %	08/12/2022	05/01/2023	$ (37 873)	$ (37 983)	(3,54)
	4,430	12/12/2022	05/01/2023	(2 211)	(2 216)	(0,20)
	4,430	27/12/2022	03/01/2023	(88 641)	(88 696)	(8,27)
GRE	4,350	07/12/2022	05/01/2023	(13 703)	(13 745)	(1,28)
	4,430	12/12/2022	05/01/2023	(1 250)	(1 253)	(0,12)
	4,450	15/12/2022	12/01/2023	(963)	(964)	(0,09)
Total des Contrats de prise en pension					**$ (144 857)**	**(13,50)**

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos[1]	En % de l'actif net
CSN	4,420 %	27/12/2022	03/01/2023	$ (4 074)	$ (4 077)	(0,38)
Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos					**$ (4 077)**	**(0,38)**

(1) Le montant à payer sur les opérations par vente et rachat dos-à-dos comprend 1 $ de baisse de prix différée.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ (1 233)	$ 1 360	$ 127	$ (84)	$ 0	$ (84)
BPS	(2 779)	2 650	(129)	(38)	20	(18)
BRC	8	0	8	S/O	S/O	S/O
CBK	903	(890)	13	(834)	836	2
CLY	(22)	0	(22)	S/O	S/O	S/O
GLM	(802)	751	(51)	(510)	391	(119)
HUS	S/O	S/O	S/O	271	(630)	(359)
JPM	97	(190)	(93)	(137)	0	(137)
MBC	1 204	(980)	224	S/O	S/O	S/O
MYC	(1 239)	510	(729)	S/O	S/O	S/O
MYI	(103)	30	(73)	0	(170)	(170)
RBC	(1)	0	(1)	197	0	197
SAL	(4)	0	(4)	S/O	S/O	S/O

Contrepartie	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
SCX	$ 277	$ (230)	$ 47	$ 407	$ (330)	$ 77
TOR	5	(10)	(5)	171	0	171
UAG	215	0	215	(454)	0	(454)

[1] L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	70,91	44,41
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	43,49	45,03
Autres valeurs mobilières	0,78	0,25
Fonds d'investissement	7,98	9,62
Contrats de mise en pension	0,09	2,05
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,21	(0,08)
Instruments financiers dérivés compensés	(0,55)	(0,12)
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,32)	(0,09)
Titres vendus à découvert	(7,17)	(3,23)
Contrats de prise en pension	(13,50)	S/O
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	(0,38)	S/O

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Obligations et billets privés	28,04	32,21
Agences du gouvernement américain	22,99	11,35
Obligations du Trésor américain	47,28	4,05
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	6,37	6,41
Titres adossés à des actifs	9,23	5,91
Émissions souveraines	S/O	0,41
Instruments à court terme	1,27	29,35
Fonds d'investissement	7,98	9,62
Contrats de mise en pension	0,09	2,05
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,21	(0,08)
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	S/O	0,00
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	S/O
Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection	(0,07)	S/O
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	S/O	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(0,48)	(0,12)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,03	S/O
Options vendues		
Swaptions de taux d'intérêt	(0,19)	(0,03)
Options sur titres	0,00	S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,07)	S/O
Contrats de change à terme	(0,27)	(0,15)
Contrats de change à terme couverts	0,18	0,09
Titres vendus à découvert	(7,17)	(3,23)
Autres actifs et passifs à court terme	(15,42)	2,16
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Carnival Corp.				
7,384 % éch. 30/06/2025	$	691	$ 665	0,10
Delos Finance SARL				
6,480 % éch. 06/10/2023		420	420	0,07
FinCo LLC				
6,884 % éch. 27/06/2025		148	147	0,02
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				
8,165 % éch. 16/11/2025		2 500	2 363	0,36
			3 595	0,55
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				
Aegon Bank NV				
0,625 % éch. 21/06/2024	€	3 300	3 362	0,51
AerCap Ireland Capital DAC				
1,150 % éch. 29/10/2023	$	1 700	1 636	0,25
2,875 % éch. 14/08/2024		700	663	0,10
Ally Financial, Inc.				
1,450 % éch. 02/10/2023		500	485	0,07
American Tower Corp.				
1,450 % éch. 15/09/2026		4 000	3 495	0,53
3,650 % éch. 15/03/2027		900	842	0,13
Ares Capital Corp.				
2,875 % éch. 15/06/2027		800	679	0,10
Aroundtown S.A.				
0,000 % éch. 16/07/2026 (c)	€	1 000	762	0,12
Assurant, Inc.				
4,200 % éch. 27/09/2023	$	1 125	1 113	0,17
Athene Global Funding				
4,898 % éch. 24/05/2024		2 500	2 457	0,38
Aviation Capital Group LLC				
3,875 % éch. 01/05/2023		500	496	0,08
4,375 % éch. 30/01/2024		800	780	0,12
5,500 % éch. 15/12/2024		700	688	0,11
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % éch. 18/11/2027		529	424	0,07
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
1,875 % éch. 09/01/2026	€	900	826	0,13
2,625 % éch. 28/04/2025		500	484	0,07
3,625 % éch. 24/09/2024		4 100	4 164	0,64
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
0,875 % éch. 18/09/2023	$	1 400	1 356	0,21
Banco Bradesco S.A.				
2,850 % éch. 27/01/2023		700	699	0,11
Banco BTG Pactual S.A.				
4,500 % éch. 10/01/2025		500	483	0,07
Banco de Sabadell S.A.				
1,750 % éch. 10/05/2024	€	500	514	0,08
5,125 % éch. 10/11/2028		600	643	0,10
5,375 % éch. 08/09/2026		500	531	0,08
Banco Santander Chile				
2,700 % éch. 10/01/2025	$	500	475	0,07
Banco Santander S.A.				
1,500 % éch. 14/04/2026	£	1 700	1 786	0,27
Bancolombia S.A.				
3,000 % éch. 29/01/2025	$	300	285	0,04
Bank of America Corp.				
1,949 % éch. 27/10/2026	€	600	602	0,09
2,375 % éch. 19/06/2024		10 200	10 764	1,64
Bank of China Luxembourg S.A.				
0,125 % éch. 16/01/2023		1 300	1 386	0,21
Bank of Ireland Group PLC				
6,253 % éch. 16/09/2026	$	1 100	1 092	0,17
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT				
4,625 % éch. 20/07/2023		700	698	0,11
Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.				
4,875 % éch. 25/09/2025	£	3 000	3 576	0,55
Barclays PLC				
3,375 % éch. 02/04/2025	€	400	423	0,06
6,024 % éch. 16/05/2024	$	709	709	0,11
7,250 % éch. 15/03/2023 (d)(f)	£	600	715	0,11
Blackstone Private Credit Fund				
2,350 % éch. 22/11/2024	$	900	824	0,13
4,700 % éch. 24/03/2025	$	700	$ 672	0,10
BNP Paribas S.A.				
2,219 % éch. 09/06/2026		1 500	1 379	0,21
3,800 % éch. 10/01/2024		500	491	0,08
BPCE S.A.				
1,652 % éch. 06/10/2026		300	267	0,04
Canadian Imperial Bank of Commerce				
4,706 % éch. 14/12/2023		700	698	0,11
Cantor Fitzgerald LP				
4,500 % éch. 14/04/2027		600	557	0,09
Charles Schwab Corp.				
0,750 % éch. 18/03/2024		600	570	0,09
4,824 % éch. 18/03/2024		1 500	1 495	0,23
China Construction Bank Europe S.A.				
0,000 % éch. 28/06/2024 (c)	€	2 800	2 833	0,43
Citigroup, Inc.				
2,014 % éch. 25/01/2026 (h)	$	2 000	1 855	0,28
3,290 % éch. 17/03/2026 (h)		3 200	3 044	0,47
Cooperatieve Rabobank UA				
2,625 % éch. 22/07/2024		700	672	0,10
Corebridge Financial, Inc.				
3,650 % éch. 05/04/2027		1 800	1 681	0,26
CPI Property Group S.A.				
2,750 % éch. 12/05/2026	€	700	588	0,09
Crédit Agricole S.A.				
0,500 % éch. 24/06/2024		2 300	2 357	0,36
5,803 % éch. 22/03/2024	$	2 600	2 607	0,40
Credit Suisse AG				
6,500 % éch. 08/08/2023 (f)		1 400	1 359	0,21
Credit Suisse Group AG				
3,800 % éch. 09/06/2023		400	390	0,06
6,373 % éch. 15/07/2026		3 000	2 819	0,43
6,442 % éch. 11/08/2028		2 235	2 039	0,31
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % éch. 19/11/2025	€	1 600	1 381	0,21
CTP NV				
0,500 % éch. 21/06/2025		100	90	0,01
0,875 % éch. 20/01/2026		2 100	1 827	0,28
DAE Sukuk Difc Ltd.				
3,750 % éch. 15/02/2026	$	700	666	0,10
Danske Bank A/S				
5,795 % éch. 12/09/2023		2 100	2 100	0,32
Deutsche Bank AG				
1,447 % éch. 01/04/2025 (h)		1 600	1 487	0,23
2,129 % éch. 24/11/2026 (h)		500	442	0,07
3,961 % éch. 26/11/2025		2 700	2 582	0,39
EPR Properties				
4,500 % éch. 01/06/2027		400	351	0,05
Equitable Financial Life Global Funding				
5,500 % éch. 02/12/2025		3 200	3 196	0,49
F&G Global Funding				
2,300 % éch. 11/04/2027		1 000	881	0,13
First Abu Dhabi Bank PJSC				
1,375 % éch. 19/02/2023	£	1 000	1 196	0,18
First American Financial Corp.				
4,300 % éch. 01/02/2023	$	1 000	999	0,15
Ford Motor Credit Co. LLC				
1,514 % éch. 17/02/2023	€	500	531	0,08
1,744 % éch. 19/07/2024		100	102	0,02
2,386 % éch. 17/02/2026		300	293	0,05
2,492 % éch. 15/11/2023		100	105	0,02
2,684 % éch. 01/12/2024		1 100	1 135	0,17
3,021 % éch. 06/03/2024		1 900	1 992	0,30
3,250 % éch. 15/09/2025		200	203	0,03
4,535 % éch. 06/03/2025	£	600	688	0,11
4,950 % éch. 28/05/2027	$	500	467	0,07
5,841 % éch. 15/02/2023		200	200	0,03
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC				
6,500 % éch. 01/10/2025		688	648	0,10
Freedom Mortgage Corp.				
8,125 % éch. 15/11/2024		400	369	0,06
FS KKR Capital Corp.				
1,650 % éch. 12/10/2024		800	723	0,11
2,625 % éch. 15/01/2027		400	334	0,05
GA Global Funding Trust				
1,000 % éch. 08/04/2024		1 400	1 312	0,20
General Motors Financial Co., Inc.				
5,360 % éch. 17/11/2023	$	2 900	$ 2 893	0,44
Goldman Sachs Group, Inc.				
4,598 % éch. 24/01/2025		1 600	1 577	0,24
Groupe Bruxelles Lambert NV				
1,875 % éch. 19/06/2025	€	1 700	1 749	0,27
Growthpoint Properties International Pty. Ltd.				
5,872 % éch. 02/05/2023	$	300	299	0,05
Hamburg Commercial Bank AG				
6,250 % éch. 18/11/2024	€	2 000	2 164	0,33
HSBC Holdings PLC				
3,019 % éch. 15/06/2027		1 000	1 018	0,16
3,950 % éch. 18/05/2024	$	3 000	2 977	0,46
Huarong Finance Co. Ltd.				
2,125 % éch. 30/09/2023		1 100	1 059	0,16
Hudson Pacific Properties LP				
5,950 % éch. 15/02/2028		500	468	0,07
ING Groep NV				
1,000 % éch. 20/09/2023	€	2 000	2 105	0,32
Intesa Sanpaolo SpA				
3,375 % éch. 12/01/2023	$	3 100	3 098	0,47
5,017 % éch. 26/06/2024		2 200	2 116	0,32
7,000 % éch. 21/11/2025		600	613	0,09
Itau Unibanco Holding S.A.				
2,900 % éch. 24/01/2023		250	250	0,04
Jackson National Life Global Funding				
1,750 % éch. 12/01/2025		1 000	929	0,14
John Deere Capital Corp.				
3,871 % éch. 11/10/2024		1 000	991	0,15
JPMorgan Chase & Co.				
4,884 % éch. 10/12/2025		1 600	1 568	0,24
Kilroy Realty LP				
3,450 % éch. 15/12/2024		800	766	0,12
LeasePlan Corp. NV				
0,125 % éch. 13/09/2023	€	3 600	3 749	0,57
2,875 % éch. 24/10/2024	$	1 500	1 408	0,22
Lincoln Financing SARL				
3,625 % éch. 01/04/2024	€	200	211	0,03
Lloyds Banking Group PLC				
4,050 % éch. 16/08/2023	$	2 000	1 987	0,30
4,716 % éch. 11/08/2026		1 900	1 861	0,28
Logicor Financing SARL				
0,750 % éch. 15/07/2024	€	1 200	1 177	0,18
1,625 % éch. 15/07/2027		1 400	1 217	0,19
Lseg Netherlands BV				
0,000 % éch. 06/04/2025 (c)		1 000	990	0,15
LSEGA Financing PLC				
1,375 % éch. 06/04/2026	$	1 600	1 404	0,21
MassMutual Global Funding				
0,480 % éch. 28/08/2023		1 900	1 845	0,28
Metropolitan Life Global Funding				
0,375 % éch. 09/04/2024	€	2 100	2 159	0,33
0,450 % éch. 01/09/2023	$	300	291	0,04
0,900 % éch. 08/06/2023		1 500	1 475	0,23
Mitsubishi HC Capital, Inc.				
3,960 % éch. 19/09/2023		200	198	0,03
5,080 % éch. 15/09/2027		1 200	1 180	0,18
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
3,273 % éch. 19/09/2025	€	2 300	2 418	0,37
5,187 % éch. 26/07/2023	$	3 000	3 005	0,46
Mizuho Financial Group, Inc.				
1,020 % éch. 11/10/2023	€	400	420	0,06
5,387 % éch. 25/05/2024	$	1 900	1 890	0,29
Morgan Stanley				
0,731 % éch. 05/04/2024		2 700	2 662	0,41
MPT Operating Partnership LP				
2,500 % éch. 24/03/2026	£	700	671	0,10
MUFG Bank Ltd.				
3,200 % éch. 26/02/2023	$	1 450	1 446	0,22
National Bank of Canada				
4,580 % éch. 06/08/2024		1 500	1 483	0,23
Nationale-Nederlanden Bank NV				
0,375 % éch. 31/05/2023	€	400	423	0,06
Nationwide Building Society				
3,766 % éch. 08/03/2024	$	800	796	0,12

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
NatWest Group PLC				
2,359 % éch. 22/05/2024	$	3 000	$ 2 957	0,45
7,472 % éch. 10/11/2026		1 200	1 250	0,19
NatWest Markets PLC				
1,000 % éch. 28/05/2024	€	1 300	1 339	0,20
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
1,125 % éch. 16/09/2024	$	1 400	1 277	0,20
3,875 % éch. 21/09/2023		1 000	982	0,15
Nomura Holdings, Inc.				
1,851 % éch. 16/07/2025		200	182	0,03
2,648 % éch. 16/01/2025		2 800	2 646	0,40
5,386 % éch. 06/07/2027		2 800	2 768	0,42
NongHyup Bank				
0,875 % éch. 28/07/2024		2 500	2 344	0,36
Nordea Bank Abp				
1,125 % éch. 16/02/2027	€	900	871	0,13
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % éch. 27/01/2025		600	581	0,09
NTT Finance Corp.				
0,583 % éch. 01/03/2024	$	1 200	1 138	0,17
4,142 % éch. 26/07/2024		1 800	1 773	0,27
4,239 % éch. 25/07/2025		2 100	2 064	0,32
4,372 % éch. 27/07/2027		300	293	0,05
Nykredit Realkredit A/S				
1,375 % éch. 12/07/2027	€	3 000	2 848	0,44
Pacific Life Global Funding				
1,375 % éch. 14/04/2026	$	1 700	1 501	0,23
Principal Life Global Funding				
4,580 % éch. 23/08/2024		500	494	0,08
Protective Life Global Funding				
1,170 % éch. 15/07/2025		1 000	901	0,14
1,646 % éch. 13/01/2025		1 000	924	0,14
4,714 % éch. 06/07/2027		3 300	3 209	0,49
QNB Finance Ltd.				
1,375 % éch. 26/01/2026		300	269	0,04
3,500 % éch. 28/03/2024		1 100	1 078	0,17
Reliance Standard Life Global Funding				
2,150 % éch. 21/01/2023		500	499	0,08
Royal Bank of Canada				
4,408 % éch. 05/10/2023		600	600	0,09
Sagax AB				
2,250 % éch. 13/03/2025	€	2 200	2 169	0,33
Sagax Euro MTN NL BV				
1,625 % éch. 24/02/2026		1 500	1 409	0,22
Santander UK Group Holdings PLC				
1,532 % éch. 21/08/2026	$	1 200	1 058	0,16
3,373 % éch. 05/01/2024		2 600	2 600	0,40
6,833 % éch. 21/11/2026		2 400	2 434	0,37
SBA Tower Trust				
1,631 % éch. 15/05/2051		1 900	1 616	0,25
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
5,125 % éch. 29/10/2022 ^		1 400	164	0,03
5,250 % éch. 23/05/2023 (f)		500	67	0,01
Scentre Group Trust				
1,375 % éch. 22/03/2023	€	200	213	0,03
Shinhan Bank Co. Ltd.				
0,250 % éch. 16/10/2024		1 100	1 102	0,17
1,183 % éch. 29/09/2025	AUD	800	485	0,07
Sirius Real Estate Ltd.				
1,125 % éch. 22/06/2026	€	1 200	1 002	0,15
SLM Corp.				
3,125 % éch. 02/11/2026	$	600	511	0,08
SMBC Aviation Capital Finance DAC				
3,550 % éch. 15/04/2024		3 330	3 220	0,49
4,125 % éch. 15/07/2023		800	792	0,12
Société Générale S.A.				
1,488 % éch. 14/12/2026		2 400	2 088	0,32
4,677 % éch. 15/06/2027		3 500	3 409	0,52
Standard Chartered PLC				
0,991 % éch. 12/01/2025		1 000	945	0,14
1,214 % éch. 23/03/2025		500	472	0,07
7,767 % éch. 16/11/2028		1 700	1 804	0,28
Sumitomo Mitsui Banking Corp.				
0,010 % éch. 10/09/2025	€	5 000	4 842	0,74
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
0,800 % éch. 12/09/2023	$	700	679	0,10
Svenska Handelsbanken AB				
0,625 % éch. 30/06/2023	$	1 500	$ 1 468	0,22
1,418 % éch. 11/06/2027		300	263	0,04
Synchrony Bank				
5,400 % éch. 22/08/2025		1 400	1 375	0,21
Synchrony Financial				
4,375 % éch. 19/03/2024		600	589	0,09
Toronto-Dominion Bank				
4,448 % éch. 27/01/2023		800	800	0,12
4,634 % éch. 10/09/2024		410	405	0,06
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % éch. 18/11/2028	£	600	532	0,08
5,250 % éch. 26/01/2024		895	1 052	0,16
UBS AG				
0,375 % éch. 01/06/2023	$	1 000	980	0,15
5,125 % éch. 15/05/2024 (f)		300	297	0,05
UBS Group AG				
1,494 % éch. 10/08/2027		2 300	1 982	0,30
4,488 % éch. 12/05/2026		3 500	3 424	0,52
UniCredit SpA				
5,850 % éch. 15/11/2027	€	2 000	2 169	0,33
7,830 % éch. 04/12/2023	$	2 800	2 830	0,43
VICI Properties LP				
4,250 % éch. 01/12/2026		800	748	0,11
4,500 % éch. 01/09/2026		400	377	0,06
5,625 % éch. 01/05/2024		700	694	0,11
Virgin Money UK PLC				
0,375 % éch. 27/05/2024	€	2 500	2 619	0,40
Volkswagen Bank GmbH				
1,250 % éch. 10/06/2024		600	616	0,09
1,875 % éch. 31/01/2024		200	209	0,03
Volkswagen Financial Services AG				
0,000 % éch. 12/02/2025 (c)		2 700	2 648	0,40
Volkswagen Financial Services NV				
1,125 % éch. 18/09/2023	£	2 700	3 169	0,48
5,500 % éch. 07/12/2026		3 000	3 538	0,54
Volkswagen Leasing GmbH				
0,000 % éch. 19/07/2024 (c)	€	1 000	1 003	0,15
1,000 % éch. 16/02/2023		900	959	0,15
Vonovia SE				
1,375 % éch. 28/01/2026		1 300	1 261	0,19
Wells Fargo & Co.				
4,540 % éch. 15/08/2026	$	1 600	1 570	0,24
			274 042	41,85
INDUSTRIE				
ABB Finance BV				
0,625 % éch. 31/03/2024	€	2 100	2 172	0,33
Aeroporti di Roma SpA				
5,441 % éch. 20/02/2023	£	400	480	0,07
Air Canada Pass-Through Trust				
3,750 % éch. 15/06/2029	$	687	599	0,09
American Airlines, Inc.				
5,500 % éch. 20/04/2026		2 600	2 505	0,38
American Medical Systems Europe BV				
0,750 % éch. 08/03/2025	€	3 000	3 006	0,46
ArcelorMittal S.A.				
6,550 % éch. 29/11/2027	$	2 000	2 013	0,31
Asahi Group Holdings Ltd.				
0,010 % éch. 19/04/2024	€	1 200	1 223	0,19
0,155 % éch. 23/10/2024		500	501	0,08
Ashtead Capital, Inc.				
1,500 % éch. 12/08/2026	$	400	342	0,05
Atlantia SpA				
1,625 % éch. 03/02/2025	€	1 300	1 299	0,20
Bacardi Ltd.				
2,750 % éch. 03/07/2023		300	320	0,05
BAE Systems Holdings, Inc.				
3,850 % éch. 15/12/2025	$	1 100	1 062	0,16
BAT Capital Corp.				
1,125 % éch. 16/11/2023	€	300	314	0,05
3,222 % éch. 15/08/2024	$	900	867	0,13
Baxter International, Inc.				
4,654 % éch. 29/11/2024		2 389	2 344	0,36
Bayer AG				
0,050 % éch. 12/01/2025	€	500	498	0,08
Bayer U.S. Finance LLC				
5,779 % éch. 15/12/2023	$	1 737	$ 1 733	0,26
Berry Global, Inc.				
0,950 % éch. 15/02/2024		3 170	3 005	0,46
BlueScope Finance Americas LLC				
4,625 % éch. 25/05/2023		2 500	2 486	0,38
BMW U.S. Capital LLC				
1,250 % éch. 12/08/2026		500	438	0,07
Booking Holdings, Inc.				
0,100 % éch. 08/03/2025	€	300	296	0,05
4,000 % éch. 15/11/2026		800	862	0,13
Bureau Veritas S.A.				
1,250 % éch. 07/09/2023		700	745	0,11
CDW LLC				
2,670 % éch. 01/12/2026	$	1 800	1 601	0,24
4,125 % éch. 01/05/2025		1 149	1 118	0,17
Central Japan Railway Co.				
2,200 % éch. 02/10/2024		3 300	3 133	0,48
3,400 % éch. 06/09/2023		300	297	0,05
CGI, Inc.				
1,450 % éch. 14/09/2026		2 700	2 391	0,36
Chanel Ceres PLC				
0,500 % éch. 31/07/2026	€	1 900	1 828	0,28
Charter Communications Operating LLC				
6,090 % éch. 01/02/2024	$	250	251	0,04
China Modern Dairy Holdings Ltd.				
2,125 % éch. 14/07/2026		1 400	1 190	0,18
CommonSpirit Health				
2,760 % éch. 01/10/2024		100	96	0,01
ConocoPhillips Co.				
2,400 % éch. 07/03/2025		100	95	0,01
Continental Resources, Inc.				
2,268 % éch. 15/11/2026		500	434	0,07
CSL Finance PLC				
3,850 % éch. 27/04/2027		800	767	0,12
DAE Funding LLC				
1,550 % éch. 01/08/2024		900	837	0,13
1,625 % éch. 15/02/2024		2 500	2 374	0,36
2,625 % éch. 20/03/2025		300	281	0,04
Delta Air Lines, Inc.				
2,900 % éch. 28/10/2024		2 100	1 993	0,30
3,800 % éch. 19/04/2023		66	65	0,01
Devon Energy Corp.				
5,250 % éch. 15/10/2027		600	595	0,09
eBay, Inc.				
5,900 % éch. 22/11/2025		4 000	4 089	0,62
Enbridge, Inc.				
4,560 % éch. 17/02/2023		400	400	0,06
Energy Transfer LP				
5,550 % éch. 15/02/2028		4 000	3 973	0,61
Entergy Louisiana LLC				
0,620 % éch. 17/11/2023		1 632	1 572	0,24
0,950 % éch. 01/10/2024		1 400	1 304	0,20
EQM Midstream Partners LP				
4,000 % éch. 01/08/2024		75	72	0,01
Expedia Group, Inc.				
6,250 % éch. 01/05/2025		2 015	2 034	0,31
Flex Ltd.				
6,000 % éch. 15/01/2028		1 700	1 699	0,26
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide				
1,625 % éch. 09/07/2024	€	2 600	2 687	0,41
GE HealthCare Technologies, Inc.				
5,550 % éch. 15/11/2024	$	2 400	2 410	0,37
Geely Automobile Holdings Ltd.				
3,625 % éch. 25/01/2023		1 100	1 099	0,17
Georgia-Pacific LLC				
0,625 % éch. 15/05/2024		2 700	2 537	0,39
Global Payments, Inc.				
4,950 % éch. 15/08/2027		2 000	1 943	0,30
GN Store Nord A/S				
0,875 % éch. 25/11/2024	€	1 500	1 442	0,22
GSK Consumer Healthcare Capital NL BV				
1,250 % éch. 29/03/2026		3 700	3 649	0,56
GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC				
3,375 % éch. 24/03/2027	$	750	699	0,11

Tableau des investissements Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Home Depot, Inc.				
2,875 % éch. 15/04/2027	$	600	$ 561	0,09
HPHT Finance Ltd.				
2,875 % éch. 05/11/2024		700	668	0,10
Huntington Ingalls Industries, Inc.				
3,844 % éch. 01/05/2025		1 200	1 160	0,18
Hyatt Hotels Corp.				
1,300 % éch. 01/10/2023		1 700	1 653	0,25
4,850 % éch. 15/03/2026		300	295	0,04
Hyundai Capital America				
0,875 % éch. 14/06/2024		1 600	1 493	0,23
1,500 % éch. 15/06/2026		500	434	0,07
Illumina, Inc.				
5,800 % éch. 12/12/2025		1 500	1 512	0,23
IMCD NV				
2,125 % éch. 31/03/2027	€	2 700	2 550	0,39
Imperial Brands Finance PLC				
6,125 % éch. 27/07/2027	$	700	698	0,11
Infor, Inc.				
1,450 % éch. 15/07/2023		300	293	0,04
InterContinental Hotels Group PLC				
1,625 % éch. 08/10/2024	€	800	818	0,12
International Flavors & Fragrances, Inc.				
1,800 % éch. 25/09/2026		1 400	1 364	0,21
3,200 % éch. 01/05/2023	$	1 600	1 590	0,24
John Lewis PLC				
6,125 % éch. 21/01/2025	£	200	231	0,04
Komatsu Finance America, Inc.				
0,849 % éch. 09/09/2023	$	2 350	2 281	0,35
Kraft Heinz Foods Co.				
2,000 % éch. 30/06/2023	€	900	958	0,15
Lenovo Group Ltd.				
5,875 % éch. 24/04/2025 (i)	$	600	585	0,09
Marriott International, Inc.				
5,750 % éch. 01/05/2025		74	75	0,01
Melco Resorts Finance Ltd.				
4,875 % éch. 06/06/2025		800	736	0,11
Meta Platforms, Inc.				
3,500 % éch. 15/08/2027		1 650	1 541	0,24
Mondelez International, Inc.				
2,125 % éch. 17/03/2024		2 300	2 219	0,34
Newell Brands, Inc.				
4,450 % éch. 01/04/2026		650	613	0,09
Nissan Motor Co. Ltd.				
1,940 % éch. 15/09/2023	€	2 000	2 106	0,32
3,043 % éch. 15/09/2023	$	2 400	2 352	0,36
NXP BV				
5,000 % éch. 15/01/2033		400	379	0,06
ONEOK Partners LP				
5,000 % éch. 15/09/2023		200	200	0,03
Open Text Corp.				
6,900 % éch. 01/12/2027		3 200	3 204	0,49
Oracle Corp.				
1,650 % éch. 25/03/2026 (h)		1 900	1 703	0,26
Pacific National Finance Pty. Ltd.				
6,000 % éch. 07/04/2023		271	271	0,04
Penske Truck Leasing Co. LP				
4,125 % éch. 01/08/2023		700	696	0,11
Philip Morris International, Inc.				
5,125 % éch. 15/11/2024		2 500	2 505	0,38
Pinnacle Bidco PLC				
5,500 % éch. 15/02/2025	€	1 000	939	0,14
Qorvo, Inc.				
1,750 % éch. 15/12/2024	$	2 550	2 352	0,36
Renesas Electronics Corp.				
1,543 % éch. 26/11/2024		4 100	3 762	0,57
Royalty Pharma PLC				
0,750 % éch. 02/09/2023		1 100	1 066	0,16
Sabine Pass Liquefaction LLC				
5,000 % éch. 15/03/2027		568	558	0,08
5,750 % éch. 15/05/2024		2 500	2 502	0,38
Sands China Ltd.				
2,800 % éch. 08/03/2027		3 200	2 745	0,42
5,625 % éch. 08/08/2025		900	862	0,13
SEB S.A.				
1,375 % éch. 16/06/2025	€	500	$ 496	0,08
1,500 % éch. 31/05/2024		200	204	0,03
Sherwin-Williams Co.				
4,250 % éch. 08/08/2025	$	1 600	1 574	0,24
Silfin NV				
2,875 % éch. 11/04/2027	€	800	726	0,11
Sixt SE				
1,750 % éch. 09/12/2024		2 100	2 164	0,33
SK Hynix, Inc.				
1,000 % éch. 19/01/2024	$	1 300	1 236	0,19
SK Telecom Co. Ltd.				
3,750 % éch. 16/04/2023		200	199	0,03
Sky Ltd.				
1,875 % éch. 24/11/2023	€	2 100	2 224	0,34
Skyworks Solutions, Inc.				
0,900 % éch. 01/06/2023	$	1 600	1 569	0,24
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA SpA				
3,500 % éch. 09/10/2025	€	200	199	0,03
Southern Co.				
4,490 % éch. 10/05/2023	$	345	344	0,05
Spirit AeroSystems, Inc.				
7,500 % éch. 15/04/2025		3 100	3 070	0,47
Stryker Corp.				
0,250 % éch. 03/12/2024	€	1 000	1 004	0,15
1,125 % éch. 30/11/2023		2 500	2 621	0,40
Studio City Co. Ltd.				
7,000 % éch. 15/02/2027	$	2 800	2 623	0,40
Studio City Finance Ltd.				
6,000 % éch. 15/07/2025		600	521	0,08
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd.				
3,750 % éch. 23/01/2023		2 300	2 298	0,35
Suntory Holdings Ltd.				
2,250 % éch. 16/10/2024		1 100	1 032	0,16
Swedish Match AB				
0,875 % éch. 23/09/2024	€	500	505	0,08
Syngenta Finance NV				
3,375 % éch. 16/04/2026		2 700	2 724	0,42
4,441 % éch. 24/04/2023	$	1 000	996	0,15
4,892 % éch. 24/04/2025		400	388	0,06
T-Mobile USA, Inc.				
2,250 % éch. 15/02/2026		1 100	1 003	0,15
3,500 % éch. 15/04/2025		450	433	0,07
Take-Two Interactive Software, Inc.				
3,300 % éch. 28/03/2024		900	879	0,13
Targa Resources Corp.				
5,200 % éch. 01/07/2027		2 500	2 454	0,37
TD SYNNEX Corp.				
1,250 % éch. 09/08/2024		2 000	1 859	0,28
1,750 % éch. 09/08/2026		900	766	0,12
TenneT Holding BV				
3,875 % éch. 28/10/2028	€	600	644	0,10
Tesco Corporate Treasury Services PLC				
1,375 % éch. 24/10/2023		250	263	0,04
Thermo Fisher Scientific Finance BV				
2,003 % éch. 18/11/2023		3 700	3 943	0,60
Time Warner Cable Enterprises LLC				
8,375 % éch. 15/03/2023	$	500	503	0,08
Transurban Finance Co. Pty. Ltd.				
4,125 % éch. 02/02/2026		1 900	1 828	0,28
Ubisoft Entertainment S.A.				
0,878 % éch. 24/11/2027	€	700	580	0,09
1,289 % éch. 30/01/2023		1 800	1 917	0,29
United Airlines Pass-Through Trust				
4,300 % éch. 15/02/2027	$	543	506	0,08
United Airlines, Inc.				
4,375 % éch. 15/04/2026		1 400	1 300	0,20
Vantage Towers AG				
0,000 % éch. 31/03/2025 (c)	€	1 300	1 330	0,20
Var Energi ASA				
7,500 % éch. 15/01/2028	$	1 700	1 735	0,26
VMware, Inc.				
0,600 % éch. 15/08/2023		2 000	1 948	0,30
4,500 % éch. 15/05/2025		1 600	1 570	0,24
Volkswagen Group of America Finance LLC				
4,350 % éch. 08/06/2027	$	800	$ 768	0,12
5,206 % éch. 07/06/2024		3 000	2 986	0,46
Warnermedia Holdings, Inc.				
3,755 % éch. 15/03/2027		1 200	1 082	0,17
Weir Group PLC				
2,200 % éch. 13/05/2026		4 700	4 174	0,64
West Fraser Timber Co. Ltd.				
4,350 % éch. 15/10/2024		200	195	0,03
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.				
3,200 % éch. 15/06/2025		562	530	0,08
Woodside Finance Ltd.				
3,650 % éch. 05/03/2025		600	576	0,09
Worldline S.A.				
0,500 % éch. 30/06/2023	€	600	633	0,10
1,625 % éch. 13/09/2024		100	103	0,02
Wynn Macau Ltd.				
4,875 % éch. 01/10/2024	$	2 100	1 986	0,30
Zimmer Biomet Holdings, Inc.				
3,550 % éch. 01/04/2025		1 600	1 546	0,24
Zoetis, Inc.				
5,400 % éch. 14/11/2025		1 700	1 736	0,26
			203 088	31,02
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
Atmos Energy Corp.				
0,625 % éch. 09/03/2023		1 200	1 191	0,18
Avangrid, Inc.				
3,150 % éch. 01/12/2024		500	478	0,07
Duke Energy Corp.				
4,300 % éch. 15/03/2028		1 000	964	0,15
5,000 % éch. 08/12/2025		3 800	3 796	0,58
East Ohio Gas Co.				
1,300 % éch. 15/06/2025		1 800	1 633	0,25
EnBW International Finance BV				
3,625 % éch. 22/11/2026	€	2 000	2 139	0,33
Enel Finance America LLC				
7,100 % éch. 14/10/2027	$	200	207	0,03
Enel Finance International NV				
0,000 % éch. 17/06/2024 (c)	€	800	813	0,12
1,375 % éch. 12/07/2026	$	1 000	863	0,13
2,650 % éch. 10/09/2024		2 500	2 394	0,37
4,250 % éch. 15/06/2025		1 700	1 648	0,25
Evergy Missouri West, Inc.				
5,150 % éch. 15/12/2027		2 000	1 996	0,31
Eversource Energy				
4,388 % éch. 15/08/2023		700	697	0,11
Georgia Power Co.				
2,100 % éch. 30/07/2023		200	197	0,03
India Green Energy Holdings				
5,375 % éch. 29/04/2024		250	241	0,04
Ipalco Enterprises, Inc.				
3,700 % éch. 01/09/2024		1 348	1 307	0,20
Jersey Central Power & Light Co.				
4,700 % éch. 01/04/2024		1 083	1 068	0,16
Lorca Telecom Bondco S.A.				
4,000 % éch. 18/09/2027	€	600	576	0,09
Metropolitan Edison Co.				
3,500 % éch. 15/03/2023	$	3 650	3 638	0,56
Midwest Connector Capital Co. LLC				
3,900 % éch. 01/04/2024		200	194	0,03
Mississippi Power Co.				
4,623 % éch. 28/06/2024		3 090	3 029	0,46
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
2,200 % éch. 02/12/2026	AUD	2 500	1 512	0,23
4,465 % éch. 03/11/2023	$	2 900	2 889	0,44
5,342 % éch. 21/03/2024		500	497	0,08
ONEOK, Inc.				
4,550 % éch. 15/07/2028		1 600	1 513	0,23
7,500 % éch. 01/09/2023		2 418	2 445	0,37
Pacific Gas & Electric Co.				
3,250 % éch. 15/06/2023 ^		200	198	0,03
3,300 % éch. 15/03/2027 ^		300	267	0,04
3,400 % éch. 15/08/2024 ^		100	96	0,02
3,450 % éch. 01/07/2025		100	95	0,01

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
3,500 % éch. 15/06/2025 ^	$	1 700	$ 1 606	0,25
3,750 % éch. 15/02/2024 ^		200	196	0,03
3,850 % éch. 15/11/2023 ^		200	197	0,03
4,250 % éch. 01/08/2023		2 400	2 388	0,37
4,950 % éch. 08/06/2025		2 000	1 971	0,30
Pennsylvania Electric Co.				
4,150 % éch. 15/04/2025		1 950	1 875	0,29
Potomac Electric Power Co.				
3,600 % éch. 15/03/2024		1 262	1 241	0,19
PPL Electric Utilities Corp.				
4,653 % éch. 24/06/2024		148	146	0,02
San Diego Gas & Electric Co.				
2,500 % éch. 15/05/2026		226	210	0,03
Sempra Energy				
3,300 % éch. 01/04/2025		3 100	2 975	0,45
Southern California Edison Co.				
0,975 % éch. 01/08/2024		800	749	0,11
4,200 % éch. 01/06/2025		3 200	3 144	0,48
5,153 % éch. 01/04/2024		557	553	0,08
5,850 % éch. 01/11/2027		100	103	0,02
Southern Power Co.				
0,900 % éch. 15/01/2026		3 000	2 644	0,40
Sprint LLC				
7,125 % éch. 15/06/2024		125	128	0,02
7,875 % éch. 15/09/2023		1 100	1 118	0,17
State Grid Overseas Investment BVI Ltd.				
0,797 % éch. 05/08/2026	€	500	467	0,07
Systems Energy Resources, Inc.				
2,140 % éch. 09/12/2025	$	1 150	1 053	0,16
Tampa Electric Co.				
3,875 % éch. 12/07/2024		800	785	0,12
Trans-Allegheny Interstate Line Co.				
3,850 % éch. 01/06/2025		1 305	1 261	0,19
Verizon Communications, Inc.				
5,113 % éch. 20/03/2026		800	780	0,12
Vistra Operations Co. LLC				
3,550 % éch. 15/07/2024		3 325	3 191	0,49
			67 362	10,29
Total des Obligations et billets privés			544 492	83,16
OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX				
Billets State Board of Administration Finance Corp., Florida Revenue Notes, Series 2020				
1,258 % éch. 01/07/2025		1 200	1 102	0,17
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Ginnie Mae, TBA				
2,500 % éch. 01/02/2053		2 700	2 343	0,36

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				
3,500 % éch. 01/02/2053	$	17 440	$ 15 856	2,42
4,000 % éch. 01/01/2053		24 800	23 267	3,55
			41 466	6,33
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Billets du Trésor américain				
1,500 % éch. 30/11/2024		800	757	0,12
2,250 % éch. 31/03/2024 (i)		12 100	11 742	1,79
3,500 % éch. 15/09/2025		6 700	6 567	1,00
4,000 % éch. 15/12/2025		6 100	6 062	0,93
4,250 % éch. 15/10/2025		20 900	20 887	3,19
4,375 % éch. 31/10/2024 (i)(j)		23 100	23 036	3,52
			69 051	10,55
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
GSR Mortgage Loan Trust				
3,767 % éch. 25/09/2035		2	2	0,00
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
4,023 % éch. 25/11/2034		4	4	0,00
6,297 % éch. 25/09/2034		293	291	0,05
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,298 % éch. 25/01/2047		169	151	0,02
4,343 % éch. 25/01/2033		4	4	0,00
			452	0,07
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
IXIS Real Estate Capital Trust				
5,019 % éch. 25/02/2036		41	43	0,01
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,009 % éch. 25/12/2035		345	334	0,05
OCP Euro CLO DAC				
0,000 % éch. 20/01/2033 (a)	€	1 000	1 062	0,16
			1 439	0,22
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement canadien				
1,500 % éch. 01/09/2024	CAD	2 800	1 982	0,30
Obligation internationale du gouvernement français				
0,000 % éch. 25/03/2025 (c)	€	9 000	9 024	1,38
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro				
0,000 % éch. 01/04/2026 (c)		2 700	2 560	0,39
Obligation internationale du gouvernement sud-africain				
10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	139 500	8 668	1,33
Obligation internationale du gouvernement ukrainien				
7,750 % éch. 01/09/2024 ^	$	100	25	0,00
			22 259	3,40

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ACTIONS ORDINAIRES			
SERVICES FINANCIERS			
Stearns Holdings LLC « B » (b)	43 861	$ 0	0,00
BONS DE SOUSCRIPTION			
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31/12/2060	211	0	0,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BILLETS DE TRÉSORERIE				
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.				
4,800 % éch. 19/01/2023	$	4 800	4 788	0,73
Duke Energy Corp.				
4,620 % éch. 17/01/2023		800	798	0,12
Fiserv, Inc.				
4,730 % éch. 17/01/2023		700	698	0,11
			6 284	0,96
BILLETS À COURT TERME				
HF Sinclair Corp.				
2,625 % éch. 01/10/2023		1 300	1 273	0,19
Yango Justice International Ltd.				
5,300 % éch. 11/01/2022 ^		200	9	0,00
			1 282	0,19
Total des Instruments à court terme			7 566	1,15
Total des Valeurs mobilières			**$ 691 422**	**105,60**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	57 648	574	0,09
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (e)	5 163	69	0,01
Total des Fonds d'investissement		**$ 643**	**0,10**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
FICC	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 1 604	Billets du Trésor américain 0,125 % échéance 15/05/2023	$ (1 636)	$ 1 604	$ 1 604	0,24
Total des Contrats de mise en pension						**$ (1 636)**	**$ 1 604**	**$ 1 604**	**0,24**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2024	222	$ 828	0,13
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Long	06/2023	50	(1)	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Long	03/2023	135	(614)	(0,10)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	11	(16)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	66	160	0,02
				$ 357	0,05
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ 357**	**0,05**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Newell Brands, Inc.	(1,000) %	20/06/2023	$ 1 000	$ 6	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[2]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AT&T, Inc.	1,000 %	20/06/2023	$ 1 500	$ 1	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2024	1 300	(17)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2025	200	(3)	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20/12/2023	€ 500	1	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2023	$ 100	0	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2023	800	6	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2024	1 500	35	0,01
Boeing Co.	1,000	20/12/2026	1 300	(12)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2027	1 200	50	0,01
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	3 700	(28)	(0,01)
General Electric Co.	1,000	20/12/2026	400	(3)	0,00
General Motors Co.	5,000	20/12/2026	200	(16)	0,00
International Lease Finance Corp.	5,000	20/12/2023	900	(40)	(0,01)
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20/06/2026	300	(4)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2024	€ 2 200	(35)	(0,01)
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2025	500	(16)	0,00
Ryder System, Inc.	1,000	20/12/2023	$ 1 100	(7)	0,00
Stellantis NV	5,000	20/06/2026	€ 1 100	(81)	(0,01)
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2027	$ 1 000	4	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2027	1 500	9	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20/06/2024	€ 1 200	(11)	0,00
				$ (167)	(0,03)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[2]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice iTraxx Crossover 38 à 5 ans	5,000 %	20/12/2027	€ 500	$ 24	0,01
Indice iTraxx Europe Main 37 à 5 ans	1,000	20/06/2027	6 000	24	0,00
				$ 48	0,01

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250 %	15/03/2028	£ 4 900	$ (173)	(0,03)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,399	18/06/2028	¥ 77 700	21	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027	$ 9 400	(453)	(0,07)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,665	04/01/2027	BRL 26 100	(129)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,980	04/01/2027	31 000	64	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	13,026	02/01/2025	113 600	117	0,02
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,000	14/11/2023	CAD 14 700	(283)	(0,04)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,050	16/11/2023	7 800	(150)	(0,02)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,070	22/11/2023	11 900	(228)	(0,04)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,250	15/06/2024	24 700	(258)	(0,04)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,270	04/11/2023	$ 108 700	$ (3 407)	(0,52)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,300	28/04/2027	ZAR 68 300	111	0,02
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	€ 1 700	(73)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	11/05/2027	4 400	(449)	(0,07)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	3 200	(283)	(0,04)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028	16 000	(551)	(0,08)
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,250	19/09/2023	HUF 1 604 100	(246)	(0,04)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,015	03/06/2026	MXN 100 900	(181)	(0,03)
					$ (6 551)	(1,00)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ (6 664)**	**(1,02)**

(1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente - Indice iTraxx Europe 37 à 5 ans hors cote	Vente	3,000 %	15/03/2023	1 000	$ (2)	$ 0	0,00

(1) Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000 %	20/06/2026	$ 100	$ (4)	$ 1	$ (3)	0,00
JPM	Hochtief AG	5,000	20/12/2025	€ 600	139	(78)	61	0,01
	Petrobras Global Finance BV	1,000	20/06/2023	$ 100	(10)	10	0	0,00
					$ 125	$ (67)	$ 58	0,01

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	HUF 137 470	$ 304	$ 0	$ (62)	$ (62)	(0,01)
	02/2023	$ 825	CHF 781	23	0	23	0,00
	02/2023	682	NOK 6 773	6	0	6	0,00
BPS	01/2023	€ 264	$ 282	0	0	0	0,00
	02/2023	$ 43	IDR 683 475	1	0	1	0,00
	02/2023	ZAR 72 651	$ 4 047	0	(208)	(208)	(0,03)
	03/2023	$ 708	COP 3 503 969	5	0	5	0,00
	04/2023	3	CLP 2 942	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	2 709	€ 2 589	56	0	56	0,01
	02/2023	428	CHF 402	8	0	8	0,00
CBK	01/2023	€ 223	$ 236	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$ 592	BRL 3 108	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	4 554	€ 4 293	30	0	30	0,00
	02/2023	NOK 1 735	$ 177	1	0	1	0,00

Tableau des investissements Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
GLM	01/2023	BRL	3 108		583	$ 0	$ (5)	$ (5)	0,00
	03/2023	MXN	6 440		313	0	(13)	(13)	0,00
	03/2023	$	0	MXN	6	0	0	0	0,00
	04/2023		573	BRL	3 108	6	0	6	0,00
JPM	01/2023	£	12 261	$	14 806	54	0	54	0,01
	02/2023	$	75	IDR	1 180 530	1	0	1	0,00
	03/2023		81		1 270 146	1	0	1	0,00
	03/2023		108	MXN	2 145	1	0	1	0,00
MBC	01/2023	CAD	2 993	$	2 231	22	0	22	0,00
	01/2023	€	152 181		159 508	0	(2 975)	(2 975)	(0,45)
	01/2023	£	2 959		3 622	61	0	61	0,01
	02/2023	$	115	IDR	1 821 534	2	0	2	0,00
	03/2023		49		770 927	1	0	1	0,00
MYI	01/2023	AUD	534	$	359	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	€	31		34	0	0	0	0,00
	01/2023	£	5		6	0	0	0	0,00
	01/2023	$	151	€	142	1	0	1	0,00
	01/2023		20	£	17	0	0	0	0,00
	03/2023		69	IDR	1 086 205	1	0	1	0,00
RBC	02/2023		1 035	NOK	10 327	15	0	15	0,00
	03/2023	MXN	3 228	$	161	0	(2)	(2)	0,00
SCX	02/2023	$	79	IDR	1 242 170	1	0	1	0,00
	03/2023		1 149	CLP	1 025 394	44	0	44	0,01
UAG	01/2023		463	ZAR	8 053	10	0	10	0,00
	01/2023	ZAR	72 801	$	4 064	0	(209)	(209)	(0,03)
						$ 351	$ (3 484)	$ (3 133)	(0,48)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	100	€	95	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
BPS	01/2023		75		71	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	€	5 285	$	5 619	0	(24)	(24)	0,00
	01/2023	$	152 937	€	147 368	4 410	0	4 410	0,67
MBC	01/2023	€	612	$	650	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	$	162 783	€	155 276	3 006	0	3 006	0,46
SCX	01/2023		153 202		147 189	3 954	0	3 954	0,60
						$ 11 371	$ (27)	$ 11 344	1,73

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£	51	$	62	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BRC	01/2023		17		20	0	0	0	0,00
	01/2023	$	6	£	5	0	0	0	0,00
JPM	01/2023		8 958		7 418	0	(34)	(34)	(0,01)
MBC	01/2023	£	6	$	8	0	0	0	0,00
	01/2023	$	9 038	£	7 538	37	(6)	31	0,01
MYI	01/2023	£	14	$	17	1	0	1	0,00
	01/2023	$	4	£	3	0	0	0	0,00
TOR	01/2023		8 931		7 428	6	0	6	0,00
UAG	01/2023	£	4	$	5	0	0	0	0,00
						$ 44	$ (40)	$ 4	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en NOK (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BRC	01/2023	$	7 939	NOK	78 997	$ 82	$ 0	$ 82	0,02
CBK	01/2023		8 792		87 148	57	0	57	0,01
MBC	01/2023	NOK	41 771	$	4 267	25	0	25	0,01
MYI	01/2023		53 174		5 327	0	(73)	(73)	(0,01)
	01/2023	$	90	NOK	887	0	0	0	0,00
RYL	01/2023		2		23	0	0	0	0,00
SCX	01/2023		8 792		87 243	66	0	66	0,01
						$ 230	$ (73)	$ 157	0,04

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ 8 430**	**1,30**

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
2,000 % éch. 01/01/2053	$ 9 100	$ (7 407)	(1,13)
2,500 % éch. 01/01/2053	6 600	(5 590)	(0,85)
4,000 % éch. 01/12/2053 (g)	1 100	(1 032)	(0,16)
Total des Titres vendus à découvert		**$ (14 029)**	**(2,14)**
Total des Investissements		**$ 681 763**	**104,13**
Autres actifs et passifs à court terme		**$ (27 014)**	**(4,13)**
Actif net		**$ 654 749**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre vendu avant l'émission.

(b) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titre convertible conditionnel.

(g) Les titres vendus à découvert au 31 décembre 2022 sont couverts par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.

(h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,69 %) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Citigroup, Inc.	2,014 %	25/01/2026	18/01/2022	$ 2 000	$ 1 855	0,28
Citigroup, Inc.	3,290	17/03/2026	10/03/2022	3 200	3 044	0,47
Deutsche Bank AG	1,447	01/04/2025	30/03/2021	1 600	1 487	0,23
Deutsche Bank AG	2,129	24/11/2026	17/11/2020	500	442	0,07
Oracle Corp.	1,650	25/03/2026	22/03/2021	1 899	1 703	0,26
				$ 9 199	$ 8 531	1,31

(i) Des titres d'une juste valeur globale de 12 682 $ (31 décembre 2021 : 0 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

(j) Des titres d'une juste valeur globale de 1 396 $ (31 décembre 2021 : 2 682 $) ont été nantis ou livrés en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 9 433 $ (31 décembre 2021 : 9 961 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 426 $ (31 décembre 2021 : 535 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 691 422	$ 0	$ 691 422
Fonds d'investissement	643	0	0	643
Contrats de mise en pension	0	1 604	0	1 604
Instruments financiers dérivés[3]	(614)	2 737	0	2 123
Titres vendus à découvert	0	(14 029)	0	(14 029)
Totaux	**$ 29**	**$ 681 734**	**$ 0**	**$ 681 763**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 734 712	$ 30	$ 734 742
Fonds d'investissement	78 479	0	0	78 479
Contrats de mise en pension	0	892	0	892
Instruments financiers dérivés[3]	(188)	3 284	0	3 096
Titres vendus à découvert	0	(15 770)	0	(15 770)
Totaux	**$ 78 291**	**$ 723 118**	**$ 30**	**$ 801 439**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	En % de l'actif net
BOS	4,430 %	27/12/2022	03/01/2023	$ (1 709)	$ (1 710)	(0,26)
	4,480	28/12/2022	04/01/2023	(704)	(705)	(0,11)
BRC	1,750	28/09/2022	TBD(1)	(606)	(607)	(0,09)
GRE	4,350	07/12/2022	05/01/2023	(9 725)	(9 754)	(1,49)
Total des Contrats de prise en pension					**$ (12 776)**	**(1,95)**

(1) Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos(1)	En % de l'actif net
BPG	4,500 %	29/12/2022	05/01/2023	$ (1 408)	$ (1 409)	(0,22)
Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos					**$ (1 409)**	**(0,22)**

(1) Le montant à payer sur les opérations par vente et rachat dos-à-dos comprend 1 $ de baisse de prix différée.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes(1)	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes(1)
BOA	$ (35)	$ 0	$ (35)	$ (92)	$ 143	$ 51
BPS	(202)	140	(62)	181	0	181
BRC	146	(120)	26	400	(360)	40
CBK	4 468	(4 360)	108	13	0	13
DUB	S/O	S/O	S/O	10	0	10
FBF	S/O	S/O	S/O	5	0	5
GLM	(12)	16	4	(499)	392	(107)
HUS	S/O	S/O	S/O	(189)	0	(189)
JPM	84	0	84	123	(280)	(157)
MBC	170	(290)	(120)	S/O	S/O	S/O
MYC	S/O	S/O	S/O	(40)	(110)	(150)
MYI	(74)	0	(74)	474	(320)	154
RBC	13	0	13	1 627	(1 060)	567
SCX	4 065	(3 850)	215	1 238	(1 160)	78
TOR	6	(20)	(14)	1 806	(1 150)	656
UAG	(199)	270	71	262	0	262

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	73,17	59,93
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	32,43	31,03
Autres valeurs mobilières	S/O	0,10
Fonds d'investissement	0,10	9,73
Contrats de mise en pension	0,24	0,11
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,05	(0,03)
Instruments financiers dérivés compensés	(1,02)	(0,25)
Instruments financiers dérivés hors cote	1,30	0,66
Titres vendus à découvert	(2,14)	(1,95)
Contrats de prise en pension	(1,95)	S/O
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	(0,22)	(0,33)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Crédits consortiaux et cessions	0,55	0,57
Obligations et billets privés	83,16	68,84
Obligations et billets municipaux	0,17	0,15
Agences du gouvernement américain	6,33	2,61
Obligations du Trésor américain	10,55	6,35
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	0,07	0,09
Titres adossés à des actifs	0,22	0,09
Émissions souveraines	3,40	2,11
Actions ordinaires	0,00	0,00
Bons de souscription	0,00	0,00
Instruments à court terme	1,15	10,25
Fonds d'investissement	0,10	9,73
Contrats de mise en pension	0,24	0,11
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,05	(0,03)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,03)	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,01	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(1,00)	(0,25)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	(0,01)
Swaptions de taux d'intérêt	S/O	(0,05)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,01	0,01
Contrats de change à terme	(0,48)	(0,24)
Contrats de change à terme couverts	1,77	0,95
Titres vendus à découvert	(2,14)	(1,95)
Autres actifs et passifs à court terme	(4,13)	0,67
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
American Airlines, Inc.				
8,993 % éch. 20/04/2028	$	900	$ 898	0,08
Caesars Resort Collection LLC				
7,134 % éch. 23/12/2024		5 408	5 403	0,50
7,884 % éch. 21/07/2025		861	859	0,08
Carnival Corp.				
5,648 % éch. 30/06/2025	€	3 404	3 502	0,32
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.				
7,915 % éch. 21/08/2026	$	676	617	0,06
Emerald TopCo, Inc.				
7,884 % éch. 24/07/2026		73	67	0,01
Envision Healthcare Corp.				
TBD % éch. 29/04/2027 µ		123	120	0,01
TBD % éch. 29/04/2027		677	663	0,06
15,744 % éch. 28/04/2028		1 592	1 303	0,12
iHeartCommunications, Inc.				
7,384 % éch. 01/05/2026		6 300	5 794	0,54
7,634 % éch. 01/05/2026		1 711	1 581	0,15
INEOS Finance PLC				
3,898 % éch. 01/04/2024	€	7 059	7 521	0,69
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
7,445 % éch. 01/02/2029	$	858	830	0,08
Lealand Finance Co. BV				
7,384 % éch. 28/06/2024		8	5	0,00
Lealand Finance Co. BV (3,000 % en numéraire ou 5,384 % de rémunération en nature)				
8,384 % éch. 30/06/2025 (b)		24	13	0,00
Petco Health & Wellness Co., Inc.				
7,976 % éch. 03/03/2028		3 767	3 662	0,34
PetSmart, Inc.				
8,130 % éch. 11/02/2028		2 147	2 107	0,19
Poseidon BidCo S.A.S				
5,250 % - 7,452 % éch. 14/07/2028	€	4 000	3 678	0,34
PUG LLC				
7,884 % éch. 12/02/2027	$	29	24	0,00
SkyMiles IP Ltd.				
7,993 % éch. 20/10/2027		3 307	3 377	0,31
Sunshine Luxembourg SARL				
8,480 % éch. 01/10/2026		1 720	1 651	0,15
Syniverse Holdings, Inc.				
11,580 % éch. 13/05/2027		58	51	0,01
TransDigm, Inc.				
6,980 % éch. 30/05/2025		5 419	5 370	0,50
6,980 % éch. 09/12/2025		8 668	8 579	0,79
Uber Technologies, Inc.				
8,235 % éch. 04/04/2025		8 431	8 436	0,78
United Airlines, Inc.				
8,108 % éch. 21/04/2028		1 142	1 131	0,10
Westmoreland Coal Co. (15,000 % de rémunération en nature)				
15,000 % éch. 15/03/2029 (b)		14	11	0,00
Windstream Services LLC				
10,673 % éch. 21/09/2027		3	3	0,00
Wm Morrison Supermarkets PLC				
6,552 % éch. 04/11/2027	€	1 536	1 447	0,13
6,552 % éch. 31/07/2028		838	789	0,07
			69 492	6,41
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				
ADLER Group S.A.				
2,250 % éch. 27/04/2027		8 300	3 136	0,29
12,500 % éch. 31/07/2025 (k)		6 024	6 386	0,59
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % éch. 18/11/2027	$	1 389	1 112	0,10
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
1,875 % éch. 09/01/2026	€	3 000	2 754	0,25
2,625 % éch. 28/04/2025		1 980	1 918	0,18
8,000 % éch. 22/01/2030		481	450	0,04
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % éch. 17/09/2024	PEN	600	147	0,01
Barclays PLC				
6,125 % éch. 15/12/2025 (g)(i)	$	1 080	$ 987	0,09
7,250 % éch. 15/03/2023 (g)(i)	£	1 800	2 146	0,20
7,750 % éch. 15/09/2023 (g)(i)	$	800	783	0,07
Bevco Lux SARL				
1,000 % éch. 16/01/2030	€	4 400	3 539	0,33
BGC Partners, Inc.				
4,375 % éch. 15/12/2025	$	1 200	1 126	0,10
Corsair International Ltd.				
5,473 % éch. 28/01/2027	€	1 000	1 059	0,10
Credit Suisse Group AG				
4,194 % éch. 01/04/2031	$	5 000	3 891	0,36
6,373 % éch. 15/07/2026		2 400	2 255	0,21
6,442 % éch. 11/08/2028		3 150	2 873	0,26
7,500 % éch. 17/07/2023 (g)(i)		800	641	0,06
7,500 % éch. 11/12/2023 (g)(i)		1 100	963	0,09
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % éch. 19/11/2025	€	167	144	0,01
Deutsche Bank AG				
3,547 % éch. 18/09/2031	$	800	643	0,06
Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust				
5,250 % éch. 30/05/2025		32	32	0,00
EPR Properties				
4,750 % éch. 15/12/2026		8	7	0,00
4,950 % éch. 15/04/2028		34	29	0,00
Erste Group Bank AG				
6,500 % éch. 15/04/2024 (g)(i)	€	200	209	0,02
Ford Motor Credit Co. LLC				
2,700 % éch. 10/08/2026	$	2 600	2 261	0,21
4,535 % éch. 06/03/2025	£	1 801	2 064	0,19
GLP Capital LP				
4,000 % éch. 15/01/2030	$	100	88	0,01
5,300 % éch. 15/01/2029		3 888	3 686	0,34
5,750 % éch. 01/06/2028		500	493	0,05
HSBC Holdings PLC				
2,848 % éch. 04/06/2031		5 900	4 721	0,44
4,950 % éch. 31/03/2030		1 320	1 262	0,12
Huarong Finance Co. Ltd.				
2,500 % éch. 24/02/2023		1 600	1 588	0,15
3,875 % éch. 13/11/2029		1 340	1 060	0,10
Intesa Sanpaolo SpA				
7,750 % éch. 11/01/2027 (g)(i)	€	1 200	1 239	0,11
Lloyds Banking Group PLC				
4,947 % éch. 27/06/2025 (g)(i)		200	205	0,02
MPT Operating Partnership LP				
3,692 % éch. 05/06/2028	£	100	88	0,01
Nationwide Building Society				
4,302 % éch. 08/03/2029	$	2 100	1 898	0,18
Navient Corp.				
5,500 % éch. 25/01/2023		2 900	2 900	0,27
Omega Healthcare Investors, Inc.				
3,625 % éch. 01/10/2029		62	51	0,00
OneMain Finance Corp.				
5,625 % éch. 15/03/2023		2 794	2 788	0,26
Park Aerospace Holdings Ltd.				
4,500 % éch. 15/03/2023		587	586	0,05
Santander UK Group Holdings PLC				
6,750 % éch. 24/06/2024 (g)(i)	£	4 169	4 832	0,45
SLM Student Loan Trust				
2,596 % éch. 15/12/2033	€	3 416	3 480	0,32
UBS AG				
5,125 % éch. 15/05/2024 (i)	$	5 770	5 707	0,53
UniCredit SpA				
7,830 % éch. 04/12/2023		12 260	12 390	1,14
Unique Pub Finance Co. PLC				
7,395 % éch. 28/03/2024	£	37	44	0,00
Uniti Group LP				
6,500 % éch. 15/02/2029	$	1 875	1 246	0,11
7,875 % éch. 15/02/2025		7 504	7 280	0,67
VICI Properties LP				
4,500 % éch. 01/09/2026		2 000	1 885	0,17
4,500 % éch. 15/01/2028		4 325	3 993	0,37
4,625 % éch. 01/12/2029		4 900	4 467	0,41
			109 532	10,10
INDUSTRIE				
Alaska Airlines Pass-Through Trust				
4,800 % éch. 15/02/2029	$	2 192	$ 2 091	0,19
Altice France S.A.				
8,125 % éch. 01/02/2027		3 400	3 104	0,29
American Airlines Pass-Through Trust				
3,375 % éch. 01/11/2028		63	52	0,01
American Airlines, Inc.				
5,500 % éch. 20/04/2026		6 948	6 694	0,62
Bombardier, Inc.				
7,500 % éch. 15/03/2025		3 108	3 084	0,28
British Airways Pass-Through Trust				
4,250 % éch. 15/05/2034		483	434	0,04
Broadcom, Inc.				
3,469 % éch. 15/04/2034		4 217	3 377	0,31
Carvana Co.				
5,500 % éch. 15/04/2027		120	48	0,00
10,250 % éch. 01/05/2030		3 700	1 746	0,16
CDW LLC				
2,670 % éch. 01/12/2026		6 460	5 747	0,53
Community Health Systems, Inc.				
5,625 % éch. 15/03/2027		4 154	3 570	0,33
8,000 % éch. 15/03/2026		742	677	0,06
CoStar Group, Inc.				
2,800 % éch. 15/07/2030		1 300	1 065	0,10
DISH DBS Corp.				
5,250 % éch. 01/12/2026		2 550	2 153	0,20
5,750 % éch. 01/12/2028		2 520	2 016	0,19
Dufry One BV				
3,625 % éch. 15/04/2026	CHF	7 394	7 036	0,65
Expedia Group, Inc.				
6,250 % éch. 01/05/2025	$	1 095	1 105	0,10
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
6,500 % éch. 15/03/2030		3 297	2 956	0,27
JetBlue Pass-Through Trust				
4,000 % éch. 15/05/2034		2 868	2 558	0,24
Market Bidco Finco PLC				
4,750 % éch. 04/11/2027	€	2 100	1 808	0,17
Marriott International, Inc.				
4,625 % éch. 15/06/2030	$	530	496	0,05
Melco Resorts Finance Ltd.				
5,625 % éch. 17/07/2027		900	773	0,07
Mitchells & Butlers Finance PLC				
6,013 % éch. 15/12/2030	£	37	42	0,00
Motorola Solutions, Inc.				
2,300 % éch. 15/11/2030	$	4 383	3 437	0,32
Netflix, Inc.				
3,625 % éch. 15/06/2030	€	100	99	0,01
Nissan Motor Co. Ltd.				
4,345 % éch. 17/09/2027	$	2 800	2 543	0,24
4,810 % éch. 17/09/2030		300	255	0,02
NMG Holding Co., Inc.				
7,125 % éch. 01/04/2026		400	376	0,04
Noble Finance Co. (11,000 % en numéraire ou 15,000 % de rémunération en nature)				
11,000 % éch. 15/02/2028 (b)		67	74	0,01
NPC Ukrenergo				
6,875 % éch. 09/11/2028 ^		200	36	0,00
Petroleos de Venezuela S.A.				
6,000 % éch. 16/05/2024 ^		220	11	0,00
Petroleos Mexicanos				
5,950 % éch. 28/01/2031		4 300	3 264	0,30
6,700 % éch. 16/02/2032		1 831	1 441	0,13
Prime Healthcare Services, Inc.				
7,250 % éch. 01/11/2025		6 355	5 380	0,50
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				
9,750 % éch. 01/12/2026		4 100	3 308	0,31
Rolls-Royce PLC				
4,625 % éch. 16/02/2026	€	2 900	3 010	0,28
5,750 % éch. 15/10/2027	£	1 700	1 882	0,17
Royal Caribbean Cruises Ltd.				
11,500 % éch. 01/06/2025	$	1 219	1 310	0,12
Sands China Ltd.				
2,800 % éch. 08/03/2027		1 700	1 458	0,13
3,350 % éch. 08/03/2029		400	327	0,03
4,300 % éch. 08/01/2026		2 100	1 941	0,18

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,875 % éch. 18/06/2030	$	200	$ 176	0,02
5,625 % éch. 08/08/2025		600	574	0,05
5,900 % éch. 08/08/2028		1 700	1 594	0,15
Studio City Finance Ltd.				
5,000 % éch. 15/01/2029		200	148	0,01
Surgery Center Holdings, Inc.				
10,000 % éch. 15/04/2027		2 493	2 541	0,23
Topaz Solar Farms LLC				
4,875 % éch. 30/09/2039		38	33	0,00
5,750 % éch. 30/09/2039		202	192	0,02
U.S. Renal Care, Inc.				
10,625 % éch. 15/07/2027		40	9	0,00
Uber Technologies, Inc.				
7,500 % éch. 15/05/2025		7 600	7 606	0,70
8,000 % éch. 01/11/2026		2 585	2 599	0,24
United Airlines Pass-Through Trust				
3,100 % éch. 07/01/2030		2 061	1 862	0,17
4,150 % éch. 25/02/2033		541	480	0,04
5,875 % éch. 15/04/2029		3 715	3 668	0,34
Valaris Ltd. (8,250 % en numéraire ou 12,000 % de rémunération en nature)				
8,250 % éch. 30/04/2028 (b)		19	19	0,00
Venture Global Calcasieu Pass LLC				
3,875 % éch. 15/08/2029		300	263	0,02
4,125 % éch. 15/08/2031		300	256	0,02
Viking Cruises Ltd.				
13,000 % éch. 15/05/2025		3 600	3 804	0,35
VOC Escrow Ltd.				
5,000 % éch. 15/02/2028		2 600	2 240	0,21
Weir Group PLC				
2,200 % éch. 13/05/2026		1 600	1 421	0,13
Western Midstream Operating LP				
5,041 % éch. 13/01/2023		38	38	0,00
Windstream Escrow LLC				
7,750 % éch. 15/08/2028		2 373	1 939	0,18
Wynn Las Vegas LLC				
5,500 % éch. 01/03/2025		1 733	1 649	0,15
Wynn Macau Ltd.				
5,500 % éch. 15/01/2026		1 000	919	0,09
5,625 % éch. 26/08/2028		2 700	2 312	0,21
Wynn Resorts Finance LLC				
7,750 % éch. 15/04/2025		4 404	4 387	0,41
			123 513	11,39
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC				
2,950 % éch. 15/04/2025	€	11 000	8 632	0,80
Pacific Gas & Electric Co.				
2,100 % éch. 01/08/2027	$	3 785	3 238	0,30
2,950 % éch. 01/03/2026 ^		1 797	1 649	0,15
3,150 % éch. 01/01/2026		4 474	4 162	0,38
3,250 % éch. 15/06/2023 ^		424	419	0,04
3,300 % éch. 15/03/2027 ^		773	689	0,06
3,300 % éch. 01/12/2027 ^		7 662	6 774	0,63
3,400 % éch. 15/08/2024 ^		2 173	2 087	0,19
3,450 % éch. 01/07/2025		1 869	1 771	0,16
3,500 % éch. 15/06/2025 ^		1 437	1 357	0,13
3,750 % éch. 15/02/2024 ^		1 490	1 460	0,14
3,750 % éch. 01/07/2028		1 459	1 297	0,12
3,750 % éch. 15/08/2042 ^		12	8	0,00
4,000 % éch. 01/12/2046 ^		2	1	0,00
4,300 % éch. 15/03/2045 ^		61	43	0,00
4,450 % éch. 15/04/2042 ^		66	49	0,00
4,500 % éch. 15/12/2041 ^		26	18	0,00
4,550 % éch. 01/07/2030		4 717	4 287	0,40
4,600 % éch. 15/06/2043 ^		10	8	0,00
4,750 % éch. 15/02/2044 ^		39	30	0,00
4,950 % éch. 08/06/2025		2 600	2 562	0,24
4,950 % éch. 01/07/2050		1 381	1 076	0,10
Rio Oil Finance Trust				
8,200 % éch. 06/04/2028		953	968	0,09
9,750 % éch. 06/01/2027		573	596	0,06
Sprint LLC				
7,125 % éch. 15/06/2024		6 710	6 856	0,63
			50 037	4,62
Total des Obligations et billets privés			283 082	26,11

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
OBLIGATIONS ET BILLETS CONVERTIBLES				
DISH Network Corp.				
2,375 % éch. 15/03/2024	$	600	$ 543	0,05
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Ginnie Mae, TBA				
2,500 % éch. 01/02/2053		1 400	1 215	0,11
3,500 % éch. 01/02/2053		5 000	4 598	0,42
4,000 % éch. 01/01/2053		2 700	2 555	0,24
4,500 % éch. 01/01/2053		10 900	10 576	0,97
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)				
3,500 % éch. 01/11/2047		94	88	0,01
4,000 % éch. 01/03/2049		551	526	0,05
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				
2,500 % éch. 01/02/2053		41 600	35 272	3,25
3,000 % éch. 01/02/2053		28 150	24 733	2,28
3,500 % éch. 01/02/2053		94 350	85 783	7,91
4,000 % éch. 01/01/2053		128 450	120 512	11,11
4,500 % éch. 01/02/2053		21 800	20 987	1,94
5,000 % éch. 01/02/2053		4 700	4 631	0,43
5,500 % éch. 01/02/2053		12 800	12 829	1,18
6,000 % éch. 01/01/2053		37 300	37 834	3,49
6,500 % éch. 01/01/2053		200	205	0,02
			362 344	33,41
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Obligations du Trésor américain				
2,875 % éch. 15/05/2049		4 900	3 945	0,36
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (f)				
0,125 % éch. 15/07/2024		10 228	9 899	0,91
0,125 % éch. 15/10/2024		6 875	6 622	0,61
0,125 % éch. 15/07/2030		3 045	2 728	0,25
0,125 % éch. 15/01/2031		229	203	0,02
0,125 % éch. 15/07/2031		222	197	0,02
0,250 % éch. 15/07/2029		4 895	4 484	0,41
0,250 % éch. 15/02/2050		1 275	861	0,08
0,375 % éch. 15/07/2023		9 705	9 591	0,88
0,375 % éch. 15/01/2027		218	206	0,02
0,375 % éch. 15/07/2027		61	57	0,01
0,500 % éch. 15/04/2024		9 204	8 951	0,83
0,625 % éch. 15/01/2024		12 630	12 363	1,14
0,625 % éch. 15/07/2032		9 025	8 274	0,76
0,750 % éch. 15/07/2028		1 151	1 097	0,10
0,750 % éch. 15/02/2042		396	331	0,03
0,750 % éch. 15/02/2045		1 012	820	0,08
0,875 % éch. 15/01/2029		2 332	2 223	0,21
0,875 % éch. 15/02/2047		1 605	1 317	0,12
1,000 % éch. 15/02/2046		629	535	0,05
1,000 % éch. 15/02/2048		1 692	1 425	0,13
1,000 % éch. 15/02/2049		3 327	2 785	0,26
1,375 % éch. 15/02/2044		128	119	0,01
2,125 % éch. 15/02/2040		276	292	0,03
2,125 % éch. 15/02/2041		136	144	0,01
Billets du Trésor américain				
2,375 % éch. 31/03/2029		15 600	14 187	1,31
2,875 % éch. 15/05/2032		4 500	4 149	0,38
			97 805	9,02
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
20 Times Square Trust				
3,100 % éch. 15/05/2035		3 800	3 671	0,34
225 Liberty Street Trust				
4,649 % éch. 10/02/2036		1 023	833	0,08
280 Park Avenue Mortgage Trust				
5,317 % éch. 15/09/2034		9 300	8 846	0,82
Ashford Hospitality Trust				
5,768 % éch. 15/06/2035		100	96	0,01
6,168 % éch. 15/06/2035		4 100	3 902	0,36
7,068 % éch. 15/06/2035		100	95	0,01
Atrium Hotel Portfolio Trust				
5,748 % éch. 15/06/2035		288	274	0,03
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,587 % éch. 25/09/2035 ^		2 184	915	0,08
BX Trust				
5,618 % éch. 15/11/2032		665	647	0,06
5,768 % éch. 15/11/2032		1 400	1 347	0,12
6,088 % éch. 15/05/2035		1 080	1 039	0,10

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Canada Square Funding PLC				
3,735 % éch. 17/01/2059	£	12 265	$ 14 186	1,31
ChaseFlex Trust				
5,069 % éch. 25/05/2037	$	15	15	0,00
Chester B1 Issuer PLC				
4,485 % éch. 17/01/2058	£	2 000	2 394	0,22
Chevy Chase Funding LLC Mortgage-Backed Certificates				
3,682 % éch. 25/08/2035	$	1 392	1 098	0,10
Citigroup Commercial Mortgage Trust				
3,518 % éch. 10/05/2035		15 420	14 313	1,32
5,793 % éch. 15/12/2036		2 500	2 392	0,22
Commercial Mortgage Trust				
5,418 % éch. 15/09/2033		2 800	2 632	0,24
Countrywide Alternative Loan Trust				
3,840 % éch. 25/08/2035		1 231	1 061	0,10
4,849 % éch. 25/03/2036		42	42	0,00
4,889 % éch. 25/12/2046		2 151	1 735	0,16
4,949 % éch. 25/08/2035		401	342	0,03
6,250 % éch. 25/04/2037		1 501	782	0,07
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust				
6,000 % éch. 25/04/2036		2 381	688	0,06
Credit Suisse Mortgage Capital Trust				
6,218 % éch. 15/07/2032		15 277	13 984	1,29
Finsbury Square PLC				
4,419 % éch. 16/12/2069	£	297	357	0,03
GS Mortgage Securities Corp. Trust				
6,418 % éch. 15/07/2025	$	12 240	11 804	1,09
GS Mortgage Securities Trust				
3,750 % éch. 25/10/2057		4 423	4 247	0,39
HarborView Mortgage Loan Trust				
4,529 % éch. 19/09/2037		1 703	1 463	0,13
Harbour Energy PLC				
3,844 % éch. 28/01/2054	£	4 659	5 516	0,51
3,944 % éch. 28/01/2054		3 247	3 723	0,34
Hilton Orlando Trust				
5,868 % éch. 15/12/2034	$	7 500	7 228	0,67
HomeBanc Mortgage Trust				
5,199 % éch. 25/10/2035		100	86	0,01
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				
6,518 % éch. 15/02/2035		3 050	2 856	0,26
Jupiter Mortgage PLC				
4,326 % éch. 20/07/2060	£	1 394	1 642	0,15
Kinbane DAC				
2,744 % éch. 25/09/2062	€	6 731	6 859	0,63
Lanebrook Mortgage Transaction PLC				
5,237 % éch. 12/06/2057	£	4 282	5 089	0,47
6,637 % éch. 12/06/2057		1 000	1 181	0,11
Lehman XS Trust				
4,789 % éch. 25/08/2046	$	7 896	7 065	0,65
Morgan Stanley Capital Trust				
5,968 % éch. 15/07/2035		7 056	6 820	0,63
6,268 % éch. 15/07/2035		3 014	2 899	0,27
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust				
3,790 % éch. 15/11/2032		7 453	6 648	0,61
PHH Alternative Mortgage Trust				
6,000 % éch. 25/02/2037		3 806	3 090	0,28
Precise Mortgage Funding PLC				
4,265 % éch. 16/10/2056	£	920	1 092	0,10
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
4,889 % éch. 25/08/2037	$	428	380	0,04
Residential Asset Securitization Trust				
6,609 % éch. 25/02/2037		10 845	3 100	0,29
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				
6,250 % éch. 25/08/2036		1 143	957	0,09
RESIMAC Bastille Trust				
5,102 % éch. 05/09/2057		70	70	0,01
RMAC PLC				
4,206 % éch. 12/06/2046	£	4 961	5 938	0,55
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				
3,926 % éch. 20/01/2054		3 000	3 384	0,31
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,944 % éch. 25/09/2034	$	199	187	0,02
Taurus FR DAC				
2,541 % éch. 02/02/2031	€	1 663	1 738	0,16

Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
TBW Mortgage-Backed Trust				
5,965 % éch. 25/07/2037	$	115	$ 37	0,00
Temple Quay PLC				
0,000 % éch. 24/07/2085	£	17 600	20 826	1,91
Tharaldson Hotel Portfolio Trust				
5,268 % éch. 11/11/2034	$	227	221	0,02
Thornburg Mortgage Securities Trust				
3,535 % éch. 25/12/2042		83	78	0,01
Towd Point Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2045	£	1 343	1 599	0,15
4,071 % éch. 20/10/2051		3 293	3 938	0,36
4,190 % éch. 20/02/2045		1 781	2 114	0,19
4,471 % éch. 20/02/2054		4 658	5 581	0,51
Trinidad Mortgage Securities PLC				
3,900 % éch. 24/01/2059		10	12	0,00
Trinity Square PLC				
5,629 % éch. 15/07/2059		1 000	1 152	0,11
Twin Bridges PLC				
4,386 % éch. 12/09/2050		1 507	1 809	0,17
Verus Securitization Trust				
1,977 % éch. 25/03/2060	$	131	126	0,01
3,035 % éch. 25/03/2060		100	92	0,01
3,889 % éch. 25/03/2060		200	182	0,02
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,093 % éch. 25/02/2037 ^		744	664	0,06
5,149 % éch. 25/01/2045		85	82	0,01
			211 261	19,47
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
4,829 % éch. 25/05/2037		8 392	1 449	0,13
Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates				
6,339 % éch. 25/06/2034		1 784	1 683	0,16
Amortizing Residential Collateral Trust				
5,089 % éch. 25/10/2031		193	185	0,02
Argent Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,154 % éch. 25/10/2035		100	89	0,01
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
2,801 % éch. 25/07/2036		4 140	3 888	0,36
3,479 % éch. 25/05/2036		6 449	5 836	0,54
Auto Abs Spanish Loans				
4,410 % éch. 28/02/2032	€	3 300	3 383	0,31
Bayview Financial Asset Trust				
5,889 % éch. 25/03/2037	$	460	457	0,04
Carrington Mortgage Loan Trust				
5,379 % éch. 25/06/2035		3 829	3 692	0,34
College Avenue Student Loans LLC				
4,130 % éch. 26/12/2047		22	21	0,00
5,589 % éch. 26/12/2047		22	22	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates				
5,589 % éch. 25/10/2035		1 089	1 065	0,10
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,529 % éch. 25/06/2047		1 963	1 799	0,17
4,599 % éch. 25/05/2047 ^		6 541	5 789	0,53
Denali Capital CLO Ltd.				
5,129 % éch. 15/04/2031		1 798	1 766	0,16
Fremont Home Loan Trust				
4,539 % éch. 25/10/2036		1 287	544	0,05
GSAA Home Equity Trust				
4,769 % éch. 25/03/2036		2 414	894	0,08
Harvest SBA Loan Trust				
6,266 % éch. 25/08/2044		201	201	0,02
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
4,549 % éch. 25/07/2037		384	208	0,02
4,589 % éch. 25/07/2037		5 145	2 787	0,26
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
4,529 % éch. 25/12/2036		9 085	7 640	0,70
4,579 % éch. 25/01/2037		2 965	2 128	0,20
IXIS Real Estate Capital Trust				
4,849 % éch. 25/01/2037		3 445	1 363	0,13
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
4,649 % éch. 25/06/2037		581	577	0,05
Lehman XS Trust				
4,909 % éch. 25/05/2046 ^		1 473	1 287	0,12
6,500 % éch. 25/06/2046	$	52	$ 42	0,00
6,689 % éch. 25/12/2037		1 344	1 320	0,12
Long Beach Mortgage Loan Trust				
4,669 % éch. 25/06/2036		505	473	0,04
4,989 % éch. 25/01/2036		3 176	2 881	0,27
Man GLG Euro CLO DAC				
2,118 % éch. 15/10/2030	€	2 912	3 034	0,28
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
4,539 % éch. 25/08/2037	$	326	304	0,03
4,669 % éch. 25/05/2037		4 574	2 554	0,24
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
3,549 % éch. 25/01/2035		1 330	1 112	0,10
4,589 % éch. 25/05/2037		1 008	538	0,05
4,689 % éch. 25/06/2036		1 899	1 654	0,15
5,304 % éch. 25/03/2035		251	246	0,02
Oak Hill European Credit Partners DAC				
2,186 % éch. 20/01/2032	€	2 754	2 869	0,26
Option One Mortgage Loan Trust				
4,639 % éch. 25/03/2037	$	5 076	2 501	0,23
5,814 % éch. 25/11/2034		881	852	0,08
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,964 % éch. 25/02/2035		9 677	9 278	0,86
Pretium Mortgage Credit Partners LLC				
2,487 % éch. 25/07/2051		2 526	2 345	0,22
Residential Asset Mortgage Products Trust				
5,469 % éch. 25/03/2035		2 000	1 891	0,17
SoFi Professional Loan Program LLC				
2,630 % éch. 25/07/2040		370	363	0,03
Starwood Commercial Mortgage Trust				
5,520 % éch. 15/07/2038		6 585	6 454	0,60
Structured Asset Investment Loan Trust				
5,109 % éch. 25/01/2036		521	497	0,05
5,389 % éch. 25/09/2034		1 298	1 249	0,12
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
4,619 % éch. 25/05/2047		206	198	0,02
5,364 % éch. 25/05/2035		2 900	2 815	0,26
Terwin Mortgage Trust				
5,769 % éch. 25/03/2035		406	380	0,03
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
6,114 % éch. 25/11/2035		2 250	2 204	0,20
			96 807	8,93
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement argentin				
0,500 % éch. 09/07/2030			2 796	708	0,06
1,000 % éch. 09/07/2029			120	32	0,00
1,500 % éch. 09/07/2035			1 732	415	0,04
3,500 % éch. 09/07/2041			3 129	897	0,08
15,500 % éch. 17/10/2026	ARS		1 188	1	0,00
Obligation du Trésor argentin BONCER					
1,400 % éch. 25/03/2023			241 160	732	0,07
Obligation internationale du gouvernement australien					
1,750 % éch. 21/06/2051	AUD		2 500	982	0,09
Ville autonome de Buenos Aires					
72,479 % éch. 29/03/2024 (a)	ARS		610	2	0,00
Obligation internationale du gouvernement japonais					
0,100 % éch. 01/03/2023	¥		511 000	3 874	0,36
Obligation internationale du gouvernement péruvien					
5,350 % éch. 12/08/2040	PEN		1 041	205	0,02
5,400 % éch. 12/08/2034			1	0	0,00
5,940 % éch. 12/02/2029			4 493	1 082	0,10
6,150 % éch. 12/08/2032			88	20	0,00
6,350 % éch. 12/08/2028			1 097	274	0,03
6,950 % éch. 12/08/2031			59	15	0,00
8,200 % éch. 12/08/2026			2 424	666	0,06
Provincia de Buenos Aires					
72,913 % éch. 12/04/2025 (a)	ARS		6 240	17	0,00
Obligation internationale du gouvernement roumain					
2,000 % éch. 14/04/2033	€		4 100	2 814	0,26
3,750 % éch. 07/02/2034			2 400	1 918	0,18
Obligation internationale du gouvernement russe					
4,250 % éch. 23/06/2027 ^	$		5 600	1 960	0,18
4,750 % éch. 27/05/2026 ^			200	70	0,01
5,250 % éch. 23/06/2047 ^			600	222	0,02
7,150 % éch. 12/11/2025	RUB		19 414	$ 82	0,01
7,950 % éch. 07/10/2026			13 158	56	0,01
Obligation internationale du gouvernement sud-africain					
10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR		204 800	12 725	1,17
Obligation internationale du gouvernement turc					
4,250 % éch. 13/03/2025	$		1 200	1 125	0,10
5,250 % éch. 13/03/2030			1 000	807	0,07
5,750 % éch. 11/05/2047			741	508	0,05
Obligation internationale du gouvernement vénézuélien					
8,250 % éch. 13/10/2024 ^			2 000	175	0,02
9,000 % éch. 07/05/2023 ^			1 600	140	0,01
				32 524	3,00

		ACTIONS	
ACTIONS ORDINAIRES			
SERVICES DE COMMUNICATION			
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (c)	173 174	182	0,02
iHeartMedia, Inc. « A » (c)	41 444	254	0,02
iHeartMedia, Inc. « B » (c)	32 182	177	0,02
		613	0,06
BIENS DE CONSOMMATION COURANTE			
Neiman Marcus Group Ltd. LLC (c)(k)	5 145	906	0,08
ÉNERGIE			
Noble Corp. PLC (c)	15 286	576	0,05
SERVICES FINANCIERS			
Intelsat Emergence S.A. (c)(k)	45 479	1 092	0,10
INDUSTRIE			
Westmoreland Mining Holdings LLC (c)(k)	231	2	0,00
		3 189	0,29
DROITS			
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05/12/2025	9 740	69	0,01
BONS DE SOUSCRIPTION			
Intelsat Emergence S.A. - Exp. 17/02/2027	661	2	0,00
Windstream Holdings II, LLC - Exp. 21/09/2055	361	7	0,00
		9	0,00
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT IMMOBILIER			
CBL & Associates Properties, Inc.	174	4	0,00
Uniti Group, Inc.	284	2	0,00
		6	0,00

	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BILLETS À COURT TERME			
Federal Home Loan Bank			
4,320 % éch. 06/01/2023	$ 6 300	6 300	0,58
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS			
(0,249) % éch. 11/01/2023 (d)(e)	¥ 15 000	114	0,01
(0,242) % éch. 23/01/2023 (d)(e)	120 000	910	0,08
(0,204) % éch. 06/01/2023 (d)(e)	170 000	1 288	0,12
(0,185) % éch. 13/03/2023 (d)(e)	169 000	1 281	0,12
(0,182) % éch. 20/03/2023 (d)(e)	411 000	3 116	0,29
(0,171) % éch. 20/03/2023 (d)(e)	280 000	2 123	0,20

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
(0,170) % éch. 06/01/2023 (d)(e)	¥	190 000	$ 1 440	0,13
(0,170) % éch. 16/01/2023 (d)(e)		330 000	2 501	0,23
(0,169) % éch. 11/01/2023 (d)(e)		270 000	2 046	0,19
(0,166) % éch. 13/03/2023 (d)(e)		581 000	4 405	0,41
(0,138) % éch. 06/03/2023 (d)(e)		1 863 000	14 124	1,30
(0,130) % éch. 20/02/2023 (d)(e)		2 220 000	16 829	1,55
			50 177	4,63
Total des Instruments à court terme			56 477	5,21
Total des Valeurs mobilières			**$ 1 213 608**	**111,91**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)	10 663 073	$ 106 140	9,79
Total des Fonds d'investissement		**$ 106 140**	**9,79**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
FICC	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 5 431	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 08/06/2023	$ (5 540)	$ 5 431	$ 5 432	0,50
MBC	4,320	30/12/2022	03/01/2023	93 400	Billets du Trésor américain 2,000 % échéance 30/04/2024	(96 407)	93 400	93 445	8,61
Total des Contrats de mise en pension						**$ (101 947)**	**$ 98 831**	**$ 98 877**	**9,11**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2024	42	$ 194	0,02
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2025	22	60	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2026	23	59	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2024	29	99	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2025	22	57	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2024	35	140	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2025	20	53	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2026	21	53	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2024	26	77	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2025	17	44	0,00
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	27	22	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	76	695	0,06
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	27	(138)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Court	03/2023	81	4	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Court	03/2023	1 287	776	0,07
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Court	03/2023	26	(2)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Long	03/2023	23	(4)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	82	(25)	0,00
				$ 2 164	0,20

(1) Option de style contrat à terme standardisé.

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Nbre de Contrats	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	$ 98,000	15/12/2023	50	$ (40)	$ (4)	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	50	(47)	(152)	(0,01)
				$ (87)	$ (156)	(0,01)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					**$ 2 008**	**0,19**

Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Airbus Finance BV	1,000 %	20/12/2025	€ 7 600	$ 135	0,01
Airbus Finance BV	1,000	20/06/2026	3 100	(70)	(0,01)
Airbus Finance BV	1,000	20/06/2028	200	(6)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2023	$ 400	0	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2025	700	19	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2025	2 500	(30)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	4 700	(69)	(0,01)
Boeing Co.	1,000	20/06/2023	2 900	(4)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2023	1 000	8	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2026	2 500	(9)	0,00
Bombardier, Inc.	5,000	20/06/2024	200	15	0,00
Bombardier, Inc.	5,000	20/06/2025	100	12	0,00
Devon Energy Corp.	1,000	20/12/2026	1 500	8	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20/12/2024	2 600	(126)	(0,01)
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2025	100	1	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2026	100	2	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2027	200	3	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2023	400	31	0,01
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	6 500	(11)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2025	€ 2 600	157	0,02
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2026	800	(28)	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/06/2027	1 300	(8)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2026	$ 3 000	(65)	(0,01)
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2026	400	(10)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2027	2 400	(6)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2027	2 100	14	0,00
				$ (37)	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.EM-31 à 5 ans	1,000 %	20/06/2024	$ 688	$ 23	0,00
Indice CDX.EM-32 à 5 ans	1,000	20/12/2024	510	19	0,00
Indice CDX.EM-34 à 5 ans	1,000	20/12/2025	1 196	(11)	0,00
Indice CDX.EM-36 à 5 ans	1,000	20/12/2026	13 708	58	0,01
Indice CDX.EM-38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	3 500	90	0,01
Indice CDX.HY-36 à 5 ans	5,000	20/06/2026	5 841	(347)	(0,04)
Indice CDX.HY-37 à 5 ans	5,000	20/12/2026	2 277	(55)	(0,01)
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000	20/12/2027	900	45	0,00
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000	20/12/2027	2 500	21	0,00
Indice iTraxx Asia Ex-Japan 38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	3 300	55	0,01
Indice iTraxx Crossover 38 à 5 ans	5,000	20/12/2027	€ 500	24	0,00
Indice iTraxx Europe Main 37 à 5 ans	1,000	20/06/2027	18 000	69	0,01
Indice iTraxx Europe Main 38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	3 800	59	0,01
				$ 50	0,00

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	1,060 %	21/02/2052	£ 300	$ (154)	(0,01)
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	1,096	14/02/2052	600	(302)	(0,03)
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	1,101	21/02/2052	300	(151)	(0,01)
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	1,175	28/02/2052	600	(291)	(0,03)
À recevoir[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053	2 300	20	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/03/2029	¥ 8 473 000	2 242	0,21
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,176	27/04/2027	550 000	(58)	(0,01)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400	15/06/2032	2 140 000	665	0,06
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,500	15/03/2042	1 140 000	725	0,07
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,711	27/04/2042	140 000	93	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2027	$ 3 600	302	0,03
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2029	4 070	419	0,04
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/06/2032	22 690	(2 569)	(0,24)
À recevoir[3]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,600	16/01/2026	17 200	410	0,04
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,650	08/02/2032	1 700	(247)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,730	24/02/2032	1 600	(224)	(0,02)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2025	38 000	1 363	0,13
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2029	3 538	184	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	1 608	84	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2052	28 100	4 274	0,39
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,765	16/03/2032	600	(83)	(0,01)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,783 %	22/04/2027	$ 2 100	$ (169)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,788	03/05/2027	2 300	(187)	(0,02)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2027	2 100	15	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2029	11 170	(5)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2032	10 680	106	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,250	17/06/2027	5 600	(348)	(0,03)
À recevoir[3]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,300	17/01/2026	12 300	291	0,03
À recevoir[3]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,350	17/01/2025	21 900	322	0,03
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,385	08/06/2032	1 400	119	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,436	08/06/2032	6 800	554	0,05
À recevoir[3]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,450	20/12/2024	43 700	654	0,06
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,450	04/10/2027	5 430	326	0,03
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,451	08/06/2032	8 700	699	0,07
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,605	28/06/2027	3 900	(177)	(0,02)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,900	04/10/2027	15 500	(500)	(0,05)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,050	07/09/2027	1 400	(38)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029	1 400	(42)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,050	06/09/2032	2 000	(69)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,100	09/09/2029	1 400	(37)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,350	14/12/2032	500	11	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,610	12/12/2032	1 100	1	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	5,830	02/01/2023	BRL 5 100	(17)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	5,836	02/01/2023	4 600	(15)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	5,855	02/01/2023	1 500	(5)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,140	02/01/2025	100	(1)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,160	02/01/2025	100	(1)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,220	04/01/2027	200	(1)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,245	04/01/2027	100	(1)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,260	04/01/2027	100	(1)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,350	02/01/2025	100	(1)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,715	04/01/2027	200	(1)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,870	04/01/2027	500	(2)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,000	02/01/2025	300	(1)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,015	04/01/2027	57 400	(174)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,080	02/01/2025	500	(1)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,140	02/01/2025	300	(1)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,145	02/01/2025	300	(1)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,160	02/01/2025	500	(1)	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,670	02/01/2023	400	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,690	02/01/2023	300	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,740	02/01/2023	700	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,750	02/01/2023	300	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,760	02/01/2023	800	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,900	02/01/2023	1 500	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,930	02/01/2023	200	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,939	02/01/2023	800	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,946	02/01/2023	2 000	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,960	02/01/2023	1 500	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,970	02/01/2023	2 600	1	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,500	16/06/2026	$ 88 900	8 743	0,81
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,500	16/06/2028	10 869	(1 315)	(0,12)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,750	16/06/2031	76 933	(10 170)	(0,94)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,928	06/05/2026	2 200	241	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,940	08/06/2026	2 900	310	0,03
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,000	16/12/2030	20 713	4 651	0,43
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,030	17/06/2026	3 600	373	0,04
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,235	12/05/2028	1 100	153	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	17/06/2030	4 400	533	0,05
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	16/12/2050	12 600	3 991	0,37
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	16/06/2051	8 700	2 196	0,20
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,270	04/11/2023	283 500	(8 903)	(0,82)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,317	16/12/2050	400	(152)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,360	15/02/2027	6 700	701	0,07
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,360	20/07/2031	1 400	260	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,370	19/07/2031	900	167	0,02
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,380	04/01/2027	3 600	(364)	(0,03)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,418	20/01/2027	1 300	(131)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,425	18/01/2027	2 500	(249)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,438	22/01/2051	9 000	(3 300)	(0,30)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,450	17/02/2027	6 300	636	0,06
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,450	16/07/2031	2 000	361	0,03
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	15/12/2028	7 919	(1 211)	(0,11)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	18/12/2029	1 200	140	0,01
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	05/10/2031	1 500	(266)	(0,02)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	17/06/2050	7 700	3 910	0,36
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,518	20/01/2029	800	(103)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,535	15/10/2031	1 500	(263)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,535	22/10/2031	1 000	(175)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,545	26/10/2031	1 000	(174)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,570	12/01/2027	1 400	(131)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,580	16/02/2027	2 800	(260)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,580	13/01/2051	9 300	(3 227)	(0,30)

Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,600 %	15/02/2027	$ 26 800	$ (2 449)	(0,23)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,625	06/01/2030	300	47	0,00
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,630	26/01/2029	1 300	(159)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,655	24/01/2032	1 300	(215)	(0,02)
À payer[3]	LIBOR USD à 3 mois	1,700	06/03/2024	6 400	(204)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,700	17/02/2027	25 000	(2 171)	(0,20)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,735	12/01/2032	1 100	(174)	(0,02)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,750	15/01/2030	4 600	662	0,06
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,768	02/02/2032	1 000	(155)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,785	12/08/2051	1 100	362	0,03
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,815	24/01/2052	300	(91)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,867	26/01/2052	300	(88)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,910	17/10/2049	400	126	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,988	09/02/2032	1 100	148	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	10/12/2029	21 000	2 700	0,25
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	12/02/2030	2 500	334	0,03
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	10/03/2030	1 200	139	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,008	09/02/2032	1 900	257	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,250	12/03/2050	15 700	3 596	0,34
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,543	05/02/2024	1 000	24	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,550	05/02/2024	1 000	24	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,559	05/02/2024	1 000	23	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,571	05/02/2024	500	12	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,580	05/02/2024	1 500	35	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,605	05/02/2024	1 500	34	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,607	05/02/2024	500	11	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,750	19/12/2023	19 100	258	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	3,000	19/06/2024	24 000	1 436	0,13
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	3,000	19/06/2026	12 700	983	0,09
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	4,848	11/01/2026	ZAR 16 900	(81)	(0,01)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,710	23/11/2025	6 600	1	0,00
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	3,000	21/03/2027	AUD 12 400	(651)	(0,06)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,250	18/03/2050	€ 2 500	1 057	0,10
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,294	30/06/2026	100	13	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,329	30/12/2025	200	22	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,363	30/06/2025	300	29	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,395	30/12/2024	200	16	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,425	28/06/2024	300	18	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,453	29/12/2023	400	16	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,500	17/06/2050	600	274	0,03
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	2 400	(103)	(0,01)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	11/05/2027	14 200	(1 449)	(0,13)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,700	11/04/2027	4 800	(482)	(0,04)
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	0,830	09/12/2052	16 100	475	0,04
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	9 800	(867)	(0,08)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	4 700	(415)	(0,04)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	21/09/2027	3 500	(232)	(0,02)
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	12 100	276	0,03
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,000	21/09/2032	8 900	(1 058)	(0,10)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	4,470	27/02/2023	MXN 46 600	(35)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	4,500	03/03/2023	297 900	(221)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	4,520	27/02/2023	93 200	(69)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	4,550	27/02/2023	394 100	(299)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	4,560	27/02/2023	45 700	(34)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	4,565	27/02/2023	46 600	(34)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,320	30/03/2023	924 260	361	0,03
À payer	IPC Royaume-Uni	4,000	15/09/2031	£ 900	(129)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,020	15/10/2031	1 200	(163)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,055	15/09/2031	800	(113)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,066	15/09/2031	1 700	(209)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,140	15/10/2031	2 300	(278)	(0,03)
					$ 6 117	0,57
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ 6 130**	**0,57**

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,110 %	26/07/2032	1 100	$ 178	$ 142	0,01
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,110	26/07/2032	1 600	259	330	0,03
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,053	20/07/2023	15 900	96	6	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,053	20/07/2023	15 900	96	235	0,02
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,620	22/07/2024	15 900	119	56	0,01
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,620	22/07/2024	15 900	119	178	0,02
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,590	19/07/2024	11 300	156	83	0,01
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,590	19/07/2024	11 300	155	232	0,02
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,400	20/07/2027	1 200	158	116	0,01
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,400	20/07/2027	1 400	185	256	0,02
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,170	19/07/2032	1 200	190	158	0,01
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,170	19/07/2032	1 400	222	280	0,03
							$ 1 933	$ 2 072	0,19

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente - Indice iTraxx Europe 37 à 5 ans hors cote	Vente	3,000 %	15/03/2023	2 800	$ (5)	$ (1)	0,00

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150 %	01/12/2023	6 000	$ (19)	$ (4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	01/12/2023	6 000	(19)	(45)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	19/01/2023	1 900	(8)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,500	19/01/2023	1 900	(8)	(23)	0,00
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	11/04/2023	1 800	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	11/04/2023	1 800	(6)	(28)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	28/04/2023	9 600	(17)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	28/04/2023	9 600	(17)	(136)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,150	09/01/2023	4 200	(15)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	09/01/2023	4 200	(15)	(25)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	23/01/2023	1 900	(5)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,770	23/01/2023	1 900	(5)	(10)	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	19/01/2023	1 900	(8)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,500	19/01/2023	1 900	(8)	(23)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	12/01/2023	6 000	(18)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	12/01/2023	6 000	(18)	(20)	0,00
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,690	02/04/2024	2 100	(16)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,690	02/04/2024	2 100	(16)	(26)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,150	09/01/2023	3 900	(14)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	09/01/2023	3 900	(14)	(23)	0,00
DUB	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	4 800	(29)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	4 800	(29)	(66)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,790	08/04/2024	3 300	(25)	(11)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,790	08/04/2024	3 300	(25)	(39)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,765	25/07/2023	6 900	(43)	(3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,765	25/07/2023	6 900	(43)	(121)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,468	25/07/2023	1 500	(36)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,468	25/07/2023	1 500	(36)	(79)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	4 800	(30)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	4 800	(30)	(66)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	3 900	(25)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	3 900	(25)	(50)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	3 900	(27)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	3 900	(27)	(46)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	3 900	(27)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	3 900	(27)	(44)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	3 900	(27)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	3 900	(27)	(43)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	3 900	(27)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	3 900	(27)	(51)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	3 800	(26)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	3 800	(26)	(53)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	3 800	(28)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,088	03/11/2023	3 800	(28)	(45)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,910	10/11/2023	3 700	(25)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,910	10/11/2023	3 700	(25)	(49)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	7 200	(26)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	7 200	(26)	(51)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	7 200	(25)	(4)	0,00

Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650 %	20/11/2023	7 200	$ (25)	$ (56)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	6 100	(19)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	6 100	(19)	(42)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,697	02/04/2024	12 300	(96)	(37)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,697	02/04/2024	12 300	(96)	(154)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,721	08/04/2024	4 100	(31)	(13)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,721	08/04/2024	4 100	(31)	(50)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	05/04/2023	9 900	(18)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	05/04/2023	9 900	(18)	(153)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	11/04/2023	13 200	(25)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	11/04/2023	13 200	(25)	(205)	(0,02)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	24/04/2023	9 900	(11)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	24/04/2023	9 900	(28)	(140)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	26/04/2023	9 200	(16)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	26/04/2023	9 200	(16)	(130)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	15/05/2023	8 600	(15)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	15/05/2023	8 600	(15)	(137)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547	07/03/2023	4 900	(108)	(11)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	4 900	(108)	(309)	(0,03)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	4 400	(55)	(11)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	4 400	(60)	(144)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,230	23/01/2023	5 500	(14)	(3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,730	23/01/2023	5 500	(14)	(33)	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,050	19/07/2023	6 900	(41)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,050	19/07/2023	6 900	(41)	(104)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,052	20/07/2023	6 900	(42)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,052	20/07/2023	6 900	(42)	(103)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,700	19/07/2023	1 500	(35)	(9)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,700	19/07/2023	1 500	(35)	(66)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,675	20/07/2023	1 500	(35)	(8)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,675	20/07/2023	1 500	(35)	(67)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,993	11/10/2023	4 400	(30)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,993	11/10/2023	4 400	(30)	(60)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,550	19/07/2023	400	(29)	(9)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,550	19/07/2023	400	(29)	(53)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,537	20/07/2023	400	(29)	(9)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,537	20/07/2023	400	(29)	(54)	(0,01)
							$ (2 420)	$ (3 447)	(0,32)

(1) Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

OPTIONS À TAUX D'INTÉRÊT PLAFONNÉES

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[2]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
MYC	Option d'achat - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote[1]	LIBOR USD à 1 an	0,030 %	24/07/2024	15 900	$ (119)	$ (248)	(0,02)
	Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote[1]	LIBOR USD à 1 an	0,030	24/07/2024	15 900	(119)	(22)	0,00
	Option d'achat - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote[1]	LIBOR USD à 1 an	0,026	23/07/2025	15 900	(139)	(197)	(0,02)
	Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 1 an hors cote[1]	LIBOR USD à 1 an	0,026	23/07/2025	15 900	(139)	(76)	(0,01)
	Option d'achat - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote[1]	LIBOR USD à 2 ans	0,026	23/07/2026	11 300	(200)	(279)	(0,02)
	Option de vente - Taux d'intérêt plancher à 2 ans hors cote[1]	LIBOR USD à 2 ans	0,026	23/07/2026	11 300	(200)	(128)	(0,01)
						$ (916)	$ (950)	(0,08)

(1) Cet instrument sous-jacent a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

(2) Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	$ 99,813	06/02/2023	500	$ (3)	$ (3)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	100,000	06/02/2023	400	(3)	(3)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	101,813	06/02/2023	500	(3)	(1)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	102,000	06/02/2023	400	(2)	(1)	0,00
SAL	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	97,578	06/03/2023	600	(5)	(5)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	99,578	06/03/2023	600	(4)	(4)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	101,859	05/01/2023	3 300	(10)	0	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	102,250	05/01/2023	2 200	(6)	0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	99,750	06/02/2023	3 600	(26)	(22)	(0,01)
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	100,000	06/02/2023	1 100	(8)	(8)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	101,750	06/02/2023	3 600	(21)	(8)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	102,000	06/02/2023	1 100	(7)	(2)	0,00
					$ (98)	$ (57)	(0,01)

(1) Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000 %	20/06/2023	$ 100	$ (6)	$ 6	$ 0	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	100	(12)	6	(6)	0,00
BPS	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	500	(45)	9	(36)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2024	100	(2)	3	1	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2026	900	(41)	(1)	(42)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	200	(13)	8	(5)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	640	(82)	45	(37)	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	400	(14)	(10)	(24)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2024	100	(2)	3	1	0,00
DUB	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2026	100	(4)	0	(4)	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	500	(18)	(12)	(30)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	300	(27)	5	(22)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2025	200	(11)	7	(4)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	700	(79)	37	(42)	(0,01)
HUS	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2023	300	(10)	11	1	0,00
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2024	600	(18)	18	0	0,00
MYC	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	700	(27)	(15)	(42)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	800	(71)	13	(58)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	300	(2)	3	1	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2025	200	(3)	4	1	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2026	1 400	(62)	8	(54)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2024	100	(16)	12	(4)	0,00
					$ (565)	$ 160	$ (405)	(0,04)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Indice CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500 %	16/12/2072	$ 62 300	$ 92	$ (876)	$ (784)	(0,07)
MEI	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	15 300	(74)	(48)	(122)	(0,01)
MYC	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	25 375	(78)	21	(57)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18/11/2054	25 375	(193)	73	(120)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	300	(2)	0	(2)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.13 Index	0,500	16/12/2072	25 500	86	(407)	(321)	(0,03)
					$ (169)	$ (1 237)	$ (1 406)	(0,13)

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

Contrepartie	À payer/à recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel	Date d'échéance	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	À recevoir	Indice iBoxx USD Liquid High Yield Index	S/O	1,058 %	$ 100	20/06/2023	$ (1)	$ (1)	$ (2)	0,00

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	¥	120 000	$	877	$ 0	$ (35)	$ (35)	0,00
BOA	01/2023		15 000		109	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	$	177	KRW	231 056	7	0	7	0,00
	01/2023	ZAR	4 838	$	273	0	(12)	(12)	0,00
	02/2023	CHF	4 534		4 787	0	(136)	(136)	(0,01)
	02/2023	€	2 330		2 461	0	(33)	(33)	0,00
	02/2023	£	62 535		73 790	0	(1 517)	(1 517)	(0,14)
	02/2023	¥	2 220 000		15 851	0	(1 080)	(1 080)	(0,10)
	02/2023	$	1 260	AUD	1 831	0	(16)	(16)	0,00
	02/2023		1 303	€	1 219	2	0	2	0,00
	02/2023		1 112	¥	145 500	0	(3)	(3)	0,00
	02/2023		1 011	NOK	10 030	9	0	9	0,00
	02/2023	ZAR	9 436	$	526	0	(26)	(26)	0,00
	03/2023	TWD	26 087		886	31	0	31	0,00
	03/2023	$	2 448	IDR	38 188 800	21	0	21	0,00
	03/2023	ZAR	14 262	$	808	0	(26)	(26)	0,00
BPS	01/2023	BRL	763		145	0	0	0	0,00
	01/2023	$	5 188	KRW	6 764 253	189	0	189	0,02
	02/2023	€	64 628	$	67 015	0	(2 158)	(2 158)	(0,20)
	02/2023	$	269	IDR	4 234 173	5	0	5	0,00
	03/2023	TWD	1 278	$	42	1	0	1	0,00

Tableau des investissements Fonds Low Duration Income Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	03/2023	$	31	CLP	27 019	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	03/2023		9 009	MXN	181 576	180	0	180	0,02
BRC	01/2023	CNH	590	$	85	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	SGD	37		27	0	0	0	0,00
	02/2023	CHF	2 330		2 484	0	(46)	(46)	0,00
	03/2023	¥	691 000		5 145	0	(145)	(145)	(0,01)
	03/2023	$	878	IDR	13 729 598	10	0	10	0,00
CBK	01/2023	CLP	1 383 618	$	1 555	0	(67)	(67)	(0,01)
	01/2023	PEN	64		17	0	0	0	0,00
	01/2023	$	8 895	BRL	46 687	0	(53)	(53)	(0,01)
	01/2023		1 452	CLP	1 383 152	171	0	171	0,02
	01/2023		498	PEN	1 999	25	0	25	0,00
	02/2023	CAD	5 781	$	4 232	0	(36)	(36)	0,00
	02/2023	$	1 435	AUD	2 143	21	0	21	0,00
	02/2023		1 555	CLP	1 391 239	69	0	69	0,01
	02/2023		637	€	597	2	0	2	0,00
	02/2023		2 202	NZD	3 441	0	(25)	(25)	0,00
	03/2023		177	CLP	153 388	1	0	1	0,00
	03/2023		89	PEN	357	4	0	4	0,00
	04/2023	PEN	9	$	2	0	0	0	0,00
	04/2023	$	1 039	PEN	4 154	42	0	42	0,00
DUB	01/2023	¥	960 000	$	6 818	0	(464)	(464)	(0,04)
	02/2023	ZAR	5 036		302	7	0	7	0,00
GLM	01/2023	BRL	45 924		8 617	0	(81)	(81)	(0,01)
	01/2023	CNH	612		88	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	278	ZAR	4 838	6	0	6	0,00
	01/2023	ZAR	9 640	$	539	0	(27)	(27)	0,00
	03/2023	MXN	66 851		3 252	0	(131)	(131)	(0,01)
	04/2023	$	8 466	BRL	45 924	83	0	83	0,01
	05/2023	PEN	7 303	$	1 835	0	(59)	(59)	(0,01)
	05/2023	$	194	PEN	785	10	0	10	0,00
	05/2023	ZAR	8 851	$	530	15	0	15	0,00
MBC	01/2023	SGD	148		109	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	$	4 361	CAD	5 779	0	(94)	(94)	(0,01)
	03/2023	¥	511 256	$	3 746	0	(157)	(157)	(0,02)
	03/2023	TWD	18 539		630	22	0	22	0,00
	03/2023	$	532	IDR	8 327 824	6	0	6	0,00
	05/2023	CNH	377	$	56	1	0	1	0,00
MYI	01/2023	€	944		1 006	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	SGD	551		409	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$	247	£	205	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		22	SGD	30	0	0	0	0,00
	01/2023		315	ZAR	5 488	7	0	7	0,00
	01/2023	ZAR	40 782	$	2 274	0	(120)	(120)	(0,01)
	02/2023	€	1 501		1 575	0	(32)	(32)	0,00
	02/2023	TWD	110 326		3 619	15	0	15	0,00
	02/2023	$	6 816	AUD	10 051	12	0	12	0,00
	02/2023	ZAR	40 859	$	2 274	0	(119)	(119)	(0,01)
	03/2023	TWD	16 904		574	20	0	20	0,00
	03/2023	$	748	IDR	11 733 754	10	0	10	0,00
RBC	02/2023		1 849	£	1 491	0	(53)	(53)	(0,01)
	02/2023		1 533	NOK	15 294	22	0	22	0,00
	03/2023		1	MXN	22	0	0	0	0,00
	04/2023	MXN	5 206	$	251	0	(11)	(11)	0,00
SCX	01/2023	$	243	PEN	935	2	0	2	0,00
	02/2023	£	16 792	$	20 097	0	(125)	(125)	(0,01)
	02/2023	$	179	IDR	2 822 556	3	0	3	0,00
	02/2023		10 336	¥	1 436 139	609	0	609	0,06
	03/2023		90	PEN	348	0	0	0	0,00
	04/2023	ZAR	11 298	$	614	0	(44)	(44)	0,00
SSB	03/2023	$	884	CLP	774 030	16	0	16	0,00
UAG	01/2023		372	ZAR	6 477	8	0	8	0,00
	02/2023		629	€	589	1	0	1	0,00
	02/2023		765	IDR	12 135 693	20	0	20	0,00
	03/2023	¥	2 613 000	$	19 240	0	(729)	(729)	(0,07)
	03/2023	ZAR	6 192		346	0	(15)	(15)	0,00
	09/2023		15 714		896	0	(9)	(9)	0,00
						$ 1 685	$ (7 695)	$ (6 010)	(0,55)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de distribution, E en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	207	CHF	196	$ 5	$ 0	$ 5	0,00
CBK	01/2023		355		335	8	0	8	0,00
MBC	01/2023	CHF	213	$	230	0	(1)	(1)	0,00
MYI	01/2023		322		345	0	(3)	(3)	0,00
RBC	01/2023	$	4	CHF	4	0	0	0	0,00
						$ 13	$ (4)	$ 9	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution et Z en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 338	€ 321	$ 4	$ 0	$ 4	0,00
BPS	01/2023	1 139	1 067	1	0	1	0,00
CBK	01/2023	€ 119	$ 127	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 222 202	€ 214 305	6 612	0	6 612	0,61
MBC	01/2023	€ 315	$ 335	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 238 618	€ 227 653	4 448	0	4 448	0,41
SCX	01/2023	229 355	220 354	5 918	0	5 918	0,55
				$ 16 983	$ (1)	$ 16 982	1,57

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 2 264	$ 2 759	$ 36	$ 0	$ 36	0,00
	01/2023	$ 22 171	£ 18 421	0	(9)	(9)	0,00
BRC	01/2023	£ 205	$ 247	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	$ 22 724	£ 18 962	97	(8)	89	0,01
MYI	01/2023	447	364	0	(9)	(9)	0,00
UAG	01/2023	21 640	18 012	31	0	31	0,00
				$ 164	$ (26)	$ 138	0,01

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$ 9	SGD 13	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BPS	01/2023	2 823	3 873	65	0	65	0,01
BRC	01/2023	586	792	4	0	4	0,00
GLM	01/2023	SGD 38	$ 28	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 1 192	SGD 1 617	14	0	14	0,00
MBC	01/2023	SGD 104	$ 76	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 3 241	SGD 4 426	60	0	60	0,01
MEI	01/2023	SGD 20	$ 15	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 2 763	SGD 3 794	66	0	66	0,01
RBC	01/2023	389	526	3	0	3	0,00
SCX	01/2023	14	19	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	SGD 444	$ 328	0	(3)	(3)	(0,01)
	01/2023	$ 975	SGD 1 320	9	0	9	0,00
				$ 221	$ (5)	$ 216	0,02
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						**$ 7 139**	**0,66**

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
3,500 % éch. 01/01/2053	$ 1 500	$ (1 363)	(0,13)
4,000 % éch. 01/01/2053 (j)	4 100	(3 846)	(0,35)
Total des Titres vendus à découvert		**$ (5 209)**	**(0,48)**
Total des Investissements		**$ 1 428 647**	**131,75**
Autres actifs et passifs à court terme		**$ (344 267)**	**(31,75)**
Actif net		**$ 1 084 380**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

µ La totalité ou une partie de ce montant représente des engagements de prêt non financés. Le taux d'intérêt pour la partie non financée sera déterminé au moment du financement. Pour de plus amples informations sur les engagements de prêts non financés, voir la Note 4, Titres et autres investissements, des Notes relatives aux États financiers.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(d) Titre à coupon zéro.

(e) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(f) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

(g) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(h) Affilié au Fonds.

(i) Titre convertible conditionnel.

(j) Le titre vendu à découvert au 31 décembre 2022 est couvert par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.

(k) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,10 %) :

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
ADLER Group S.A. 12,500 % échéance 31/07/2025	22/12/2022	$ 6 386	$ 6 386	0,59
Intelsat Emergence S.A.	05/09/2018 - 23/02/2022	3 227	1 092	0,10
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25/09/2020	166	906	0,08
Westmoreland Mining Holdings LLC	26/03/2019	1	2	0,00
		$ 9 780	$ 8 386	0,77

Un montant en numéraire de 24 006 $ (31 décembre 2021 : 28 338 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 1 120 $) et un montant en numéraire de 9 984 $ (31 décembre 2021 : 0 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 1 018	$ 1 197 881	$ 14 709	$ 1 213 608
Fonds d'investissement	106 140	0	0	106 140
Contrats de mise en pension	0	98 831	0	98 831
Instruments financiers dérivés[3]	579	14 698	0	15 277
Titres vendus à découvert	0	(5 209)	0	(5 209)
Totaux	**$ 107 737**	**$ 1 306 201**	**$ 14 709**	**$ 1 428 647**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 2 079	$ 1 433 257	$ 11 636	$ 1 446 972
Fonds d'investissement	132 416	0	0	132 416
Contrats de mise en pension	0	7 961	0	7 961
Instruments financiers dérivés[3]	(23)	11 048	0	11 025
Titres vendus à découvert	0	(213)	0	(213)
Totaux	**$ 134 472**	**$ 1 452 053**	**$ 11 636**	**$ 1 598 161**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ (35)	$ 0	$ (35)	$ 7	$ 0	$ 7
BOA	(2 834)	2 820	(14)	273	(230)	43
BPS	(1 952)	1 730	(222)	1 650	(1 330)	320
BRC	(307)	301	(6)	2 183	(1 290)	893
CBK	6 696	(6 666)	30	(41)	(270)	(311)
DUB	(582)	370	(212)	(22)	0	(22)
GLM	(2 097)	2 036	(61)	(1 128)	1 103	(25)
GST	(885)	904	19	245	0	245
HUS	1	0	1	864	(1 130)	(266)
MBC	4 371	(3 930)	441	S/O	S/O	S/O
MEI	(56)	260	204	175	0	175
MYC	(562)	813	251	546	(670)	(124)
MYI	(223)	270	47	(18)	17	(1)
RBC	(39)	0	(39)	2 521	(2 020)	501
SAL	(49)	0	(49)	(57)	0	(57)
SCX	6 363	(5 950)	413	3 931	(3 290)	641
SSB	16	0	16	20	0	20
UAG	(687)	480	(207)	205	(320)	(115)

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	35,07	40,62
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	75,51	59,78
Autres valeurs mobilières	1,33	5,43
Fonds d'investissement	9,79	9,68
Contrats de mise en pension	9,11	0,58
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,19	(0,04)
Instruments financiers dérivés compensés	0,57	0,01
Instruments financiers dérivés hors cote	0,66	0,83
Titres vendus à découvert	(0,48)	(0,02)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Crédits consortiaux et cessions	6,41	7,43
Obligations et billets privés	26,11	35,19
Obligations et billets convertibles	0,05	0,04
Agences du gouvernement américain	33,41	18,26
Obligations du Trésor américain	9,02	3,63
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	19,47	11,58
Titres adossés à des actifs	8,93	5,94
Émissions souveraines	3,00	3,14
Actions ordinaires	0,29	0,26
Droits	0,01	S/O
Bons de souscription	0,00	0,00
Sociétés d'investissement immobilier	0,00	0,00
Instruments à court terme	5,21	20,36
Fonds d'investissement	9,79	9,68
Contrats de mise en pension	9,11	0,58
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,20	(0,04)
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,01)	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,04
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,00	0,01
Swaps de taux d'intérêt	0,57	(0,04)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,19	0,00
Options sur titres	S/O	0,01
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Options de change	S/O	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,32)	(0,08)
Options à taux d'intérêt plafonnées	(0,08)	S/O
Options sur titres	(0,01)	(0,02)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,04)	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	(0,13)	0,06
Swaps de taux d'intérêt	S/O	0,01
Swaps de rendement total sur indices	0,00	0,00
Contrats de change à terme	(0,55)	0,04
Contrats de change à terme couverts	1,60	0,81
Titres vendus à découvert	(0,48)	(0,02)
Autres actifs et passifs à court terme	(31,75)	(16,87)
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
American Airlines, Inc.				
8,993 % éch. 20/04/2028	$	1 100	1 097	0,08
CenturyLink, Inc.				
6,634 % éch. 15/03/2027		4 395	4 182	0,31
CommScope, Inc.				
7,634 % éch. 06/04/2026		1 955	1 848	0,14
Cornerstone Building Brands, Inc.				
7,568 % éch. 12/04/2028		1 338	1 207	0,09
CSC Holdings LLC				
6,818 % éch. 15/04/2027		288	258	0,02
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
6,173 % éch. 22/06/2026		1 046	1 044	0,08
IRB Holding Corp.				
7,134 % éch. 05/02/2025		3 019	2 997	0,22
7,317 % éch. 15/12/2027		4 864	4 728	0,35
Kronos Acquisition Holdings, Inc.				
8,485 % éch. 22/12/2026		2 548	2 431	0,18
MPH Acquisition Holdings LLC				
8,985 % éch. 01/09/2028		3 851	3 307	0,25
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				
8,165 % éch. 16/11/2025		1 215	1 148	0,08
SkyMiles IP Ltd.				
7,993 % éch. 20/10/2027		1 000	1 021	0,08
U.S. Foods, Inc.				
7,134 % éch. 22/11/2028		2 637	2 629	0,19
United Airlines, Inc.				
8,108 % éch. 21/04/2028		2 164	2 143	0,16
Zayo Group Holdings, Inc.				
7,384 % éch. 09/03/2027		5 627	4 583	0,34
			34 623	2,57
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				
Acef Holding S.C.A.				
1,250 % éch. 26/04/2030	€	1 000	737	0,05
AerCap Ireland Capital DAC				
4,125 % éch. 03/07/2023	$	1 500	1 490	0,11
AGFC Capital Trust				
5,829 % éch. 15/01/2067		500	280	0,02
Aircastle Ltd.				
2,850 % éch. 26/01/2028		1 500	1 229	0,09
AMCO - Asset Management Co. SpA				
1,500 % éch. 17/07/2023	€	1 300	1 374	0,10
2,250 % éch. 17/07/2027		2 900	2 783	0,21
American Assets Trust LP				
3,375 % éch. 01/02/2031	$	2 050	1 631	0,12
American Tower Corp.				
4,050 % éch. 15/03/2032		800	716	0,05
4,400 % éch. 15/02/2026		850	829	0,06
Aroundtown S.A.				
0,000 % éch. 16/07/2026 (c)	€	800	609	0,05
0,375 % éch. 15/04/2027		1 400	991	0,07
5,375 % éch. 21/03/2029	$	3 100	2 350	0,17
Aviation Capital Group LLC				
3,875 % éch. 01/05/2023		1 000	992	0,07
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % éch. 18/11/2027		1 806	1 446	0,11
Balder Finland Oyj				
1,000 % éch. 18/01/2027	€	1 900	1 518	0,11
1,000 % éch. 20/01/2029		500	357	0,03
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
5,375 % éch. 18/01/2028		3 800	3 279	0,24
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
5,875 % éch. 24/09/2023 (f)(h)		1 800	1 851	0,14
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % éch. 17/09/2024	PEN	7 000	1 714	0,13
Bank of America Corp.				
3,384 % éch. 02/04/2026	$	2 300	2 199	0,16
3,864 % éch. 23/07/2024		1 800	1 784	0,13
Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.				
1,250 % éch. 05/12/2025	£	1 200	1 296	0,10
Barclays PLC				
3,125 % éch. 17/01/2024		100	118	0,01
4,375 % éch. 12/01/2026	$	1 700	$ 1 647	0,12
4,972 % éch. 16/05/2029		800	753	0,06
5,746 % éch. 09/08/2033		100	95	0,01
7,125 % éch. 15/06/2025 (f)(h)	£	1 800	2 052	0,15
7,250 % éch. 15/03/2023 (f)(h)		2 200	2 623	0,19
8,000 % éch. 15/06/2024 (f)(h)	$	200	195	0,01
BNP Paribas S.A.				
1,875 % éch. 14/12/2027	£	1 900	1 918	0,14
1,904 % éch. 30/09/2028	$	3 400	2 837	0,21
BPCE S.A.				
1,500 % éch. 13/01/2042 (h)	€	1 800	1 612	0,12
Brookfield Finance, Inc.				
4,000 % éch. 01/04/2024	$	50	49	0,00
CapitaLand Ascendas REIT				
0,750 % éch. 23/06/2028	€	1 100	920	0,07
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund				
0,500 % éch. 27/01/2028		1 600	1 323	0,10
0,900 % éch. 12/10/2029		1 600	1 248	0,09
Cooperatieve Rabobank UA				
3,100 % éch. 29/06/2028 (f)(h)		3 800	3 146	0,23
CPI Property Group S.A.				
1,750 % éch. 14/01/2030		3 000	1 954	0,15
2,750 % éch. 12/05/2026		2 181	1 833	0,14
2,750 % éch. 22/01/2028	£	700	564	0,04
Credit Suisse AG				
0,250 % éch. 01/09/2028	€	3 000	2 322	0,17
6,500 % éch. 08/08/2023 (h)	$	4 100	3 980	0,30
Credit Suisse Group AG				
1,000 % éch. 24/06/2027	€	500	421	0,03
2,125 % éch. 12/09/2025	£	200	214	0,02
2,125 % éch. 15/11/2029		2 400	2 055	0,15
3,091 % éch. 14/05/2032	$	3 500	2 425	0,18
3,750 % éch. 26/03/2025		150	135	0,01
4,194 % éch. 01/04/2031		800	623	0,05
4,550 % éch. 17/04/2026		1 000	883	0,07
5,250 % éch. 11/02/2027 (f)(h)		3 100	2 025	0,15
6,250 % éch. 18/12/2024 (f)(h)		200	158	0,01
6,375 % éch. 21/08/2026 (f)(h)		2 600	1 870	0,14
7,250 % éch. 12/09/2025 (f)(h)		1 600	1 150	0,09
7,500 % éch. 17/07/2023 (f)(h)		400	321	0,02
Cromwell Ereit Lux Finco SARL				
2,125 % éch. 19/11/2025	€	2 000	1 726	0,13
CTP NV				
0,625 % éch. 27/09/2026		2 700	2 221	0,16
1,500 % éch. 27/09/2031		2 500	1 604	0,12
Deutsche Bank AG				
0,750 % éch. 17/02/2027		800	746	0,06
1,625 % éch. 20/01/2027		2 000	1 885	0,14
2,625 % éch. 16/12/2024	£	3 000	3 356	0,25
3,729 % éch. 14/01/2032 (i)	$	2 200	1 617	0,12
DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH				
2,500 % éch. 25/01/2027	€	2 100	1 680	0,12
Fairfax Financial Holdings Ltd.				
4,625 % éch. 29/04/2030	$	700	637	0,05
Ford Motor Credit Co. LLC				
1,744 % éch. 19/07/2024	€	2 900	2 963	0,22
2,900 % éch. 16/02/2028	$	900	744	0,06
3,021 % éch. 06/03/2024	€	100	105	0,01
3,250 % éch. 15/09/2025		200	203	0,01
3,375 % éch. 13/11/2025	$	600	543	0,04
Goldman Sachs Group, Inc.				
0,673 % éch. 08/03/2024		1 500	1 484	0,11
3,000 % éch. 15/03/2024		3 500	3 415	0,25
3,691 % éch. 05/06/2028		100	93	0,01
Hamburg Commercial Bank AG				
0,500 % éch. 22/09/2026	€	2 500	2 270	0,17
HSBC Holdings PLC				
2,999 % éch. 10/03/2026	$	3 600	3 387	0,25
3,900 % éch. 25/05/2026		900	858	0,06
4,300 % éch. 08/03/2026		400	387	0,03
5,750 % éch. 20/12/2027	£	100	119	0,01
6,000 % éch. 29/03/2040		200	220	0,02
Huarong Finance Co. Ltd.				
3,375 % éch. 24/02/2030	$	800	611	0,05
3,625 % éch. 30/09/2030		1 500	1 151	0,09
4,250 % éch. 07/11/2027		200	171	0,01
4,500 % éch. 29/05/2029		1 400	1 163	0,09
4,750 % éch. 27/04/2027		1 000	874	0,06
ING Groep NV				
1,726 % éch. 01/04/2027	$	3 000	$ 2 651	0,20
4,100 % éch. 02/10/2023		1 000	992	0,07
Intesa Sanpaolo SpA				
7,750 % éch. 11/01/2027 (f)(h)	€	2 200	2 271	0,17
JPMorgan Chase & Co.				
1,963 % éch. 23/03/2030		1 000	933	0,07
Kennedy Wilson Europe Real Estate Ltd.				
3,250 % éch. 12/11/2025		2 900	2 434	0,18
Lazard Group LLC				
4,500 % éch. 19/09/2028	$	4 000	3 719	0,28
LeasePlan Corp. NV				
2,875 % éch. 24/10/2024		1 200	1 127	0,08
Legal & General Group PLC				
5,625 % éch. 24/03/2031 (f)(h)	£	600	623	0,05
Lloyds Banking Group PLC				
2,250 % éch. 16/10/2024		900	1 029	0,08
3,750 % éch. 11/01/2027	$	2 500	2 329	0,17
3,750 % éch. 18/03/2028		1 000	925	0,07
4,375 % éch. 22/03/2028		400	380	0,03
4,716 % éch. 11/08/2026		3 000	2 938	0,22
Logicor Financing SARL				
0,625 % éch. 17/11/2025	€	1 800	1 645	0,12
1,500 % éch. 13/07/2026		1 000	904	0,07
3,250 % éch. 13/11/2028		700	630	0,05
Midcap Financial Issuer Trust				
5,625 % éch. 15/01/2030	$	200	162	0,01
Mitsubishi HC Capital, Inc.				
3,960 % éch. 19/09/2023		1 600	1 582	0,12
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
0,339 % éch. 19/07/2024	€	1 600	1 631	0,12
Mizuho Financial Group, Inc.				
3,477 % éch. 12/04/2026	$	3 050	2 864	0,21
MPT Operating Partnership LP				
3,375 % éch. 24/04/2030	£	1 500	1 183	0,09
Nationwide Building Society				
1,000 % éch. 24/01/2023		300	360	0,03
3,766 % éch. 08/03/2024	$	1 100	1 094	0,08
NatWest Group PLC				
2,000 % éch. 04/03/2025	€	2 300	2 395	0,18
4,519 % éch. 25/06/2024	$	200	198	0,01
4,800 % éch. 05/04/2026		700	685	0,05
4,892 % éch. 18/05/2029		700	664	0,05
6,274 % éch. 25/06/2024		400	400	0,03
8,000 % éch. 10/08/2025 (f)(h)		300	296	0,02
NE Property BV				
1,875 % éch. 09/10/2026	€	1 500	1 349	0,10
2,000 % éch. 20/01/2030		3 100	2 297	0,17
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
2,450 % éch. 15/09/2028	$	800	623	0,05
Nova Kreditna Banka Maribor d.d.				
1,875 % éch. 27/01/2025	€	2 200	2 130	0,16
Nova Ljubljanska Banka d.d.				
3,400 % éch. 05/02/2030		2 400	2 126	0,16
3,650 % éch. 19/11/2029		1 400	1 255	0,09
OneMain Finance Corp.				
6,125 % éch. 15/03/2024	$	2 150	2 084	0,15
Peugeot Invest				
1,875 % éch. 30/10/2026	€	3 800	3 334	0,25
Piper Sandler Cos.				
5,200 % éch. 15/10/2023	$	1 600	1 586	0,12
Protective Life Global Funding				
3,104 % éch. 15/04/2024		5 000	4 861	0,36
Rexford Industrial Realty LP				
2,150 % éch. 01/09/2031		21	16	0,00
Sagax AB				
1,125 % éch. 30/01/2027	€	1 700	1 470	0,11
2,250 % éch. 13/03/2025		2 900	2 860	0,21
Sagax Euro MTN NL BV				
0,750 % éch. 26/01/2028		600	482	0,04
1,000 % éch. 17/05/2029		1 000	751	0,06
Santander Holdings USA, Inc.				
3,244 % éch. 05/10/2026	$	100	93	0,01
Santander UK Group Holdings PLC				
3,625 % éch. 14/01/2026	£	300	336	0,02
3,823 % éch. 03/11/2028	$	300	269	0,02
4,796 % éch. 15/11/2024		4 000	3 934	0,29

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Sirius Real Estate Ltd.				
1,125 % éch. 22/06/2026	€	1 100	$ 919	0,07
Société Générale S.A.				
7,875 % éch. 18/12/2023 (f)(h)	$	200	198	0,01
Sofina S.A.				
1,000 % éch. 23/09/2028	€	2 500	2 087	0,15
Standard Chartered PLC				
1,214 % éch. 23/03/2025	$	1 500	1 416	0,11
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.				
2,550 % éch. 10/03/2025		2 400	2 264	0,17
Sun Communities Operating LP				
4,200 % éch. 15/04/2032		2 500	2 209	0,16
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % éch. 18/11/2028	£	1 000	887	0,07
5,250 % éch. 26/01/2024		358	421	0,03
5,250 % éch. 29/05/2026		1 400	1 559	0,12
UBS AG				
5,125 % éch. 15/05/2024 (h)	$	100	99	0,01
UniCredit SpA				
7,500 % éch. 03/06/2026 (f)(h)	€	1 800	1 873	0,14
7,830 % éch. 04/12/2023	$	500	505	0,04
VICI Properties LP				
4,375 % éch. 15/05/2025		1 300	1 264	0,09
Virgin Money UK PLC				
4,000 % éch. 25/09/2026	£	300	335	0,02
Volkswagen Financial Services NV				
1,125 % éch. 18/09/2023		3 100	3 639	0,27
1,625 % éch. 10/02/2024		1 100	1 268	0,09
1,875 % éch. 03/12/2024		2 000	2 248	0,17
			205 248	15,25
INDUSTRIE				
Aeroporti di Roma SpA				
1,750 % éch. 30/07/2031	€	600	478	0,04
5,441 % éch. 20/02/2023	£	800	961	0,07
Air Canada				
3,875 % éch. 15/08/2026	$	1 200	1 065	0,08
Alaska Airlines Pass-Through Trust				
4,800 % éch. 15/02/2029		1 771	1 689	0,13
Altice France S.A.				
4,250 % éch. 15/10/2029	€	2 000	1 609	0,12
5,500 % éch. 15/10/2029	$	2 100	1 605	0,12
AMC Networks, Inc.				
4,750 % éch. 01/08/2025		100	76	0,01
American Airlines Pass-Through Trust				
3,150 % éch. 15/08/2033		605	502	0,04
3,250 % éch. 15/04/2030		18	14	0,00
3,375 % éch. 01/11/2028		1 064	889	0,07
3,650 % éch. 15/08/2030		734	655	0,05
3,700 % éch. 01/04/2028		230	199	0,01
American Airlines, Inc.				
5,500 % éch. 20/04/2026		2 900	2 794	0,21
American Medical Systems Europe BV				
1,375 % éch. 08/03/2028	€	2 000	1 888	0,14
Atlantia SpA				
1,875 % éch. 12/02/2028		3 900	3 470	0,26
Bellis Acquisition Co. PLC				
3,250 % éch. 16/02/2026	£	5 200	5 113	0,38
Boeing Co.				
2,750 % éch. 01/02/2026	$	2 100	1 948	0,14
Boston Scientific Corp.				
3,450 % éch. 01/03/2024		525	515	0,04
British Airways Pass-Through Trust				
3,300 % éch. 15/06/2034		89	76	0,01
4,250 % éch. 15/05/2034		322	289	0,02
Broadcom, Inc.				
3,469 % éch. 15/04/2034		200	160	0,01
Chanel Ceres PLC				
0,500 % éch. 31/07/2026	€	1 300	1 251	0,09
1,000 % éch. 31/07/2031		2 100	1 731	0,13
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC				
5,875 % éch. 31/03/2025	$	20	20	0,00
Constellation Oil Services Holding S.A. (3,000 % en numéraire ou 4,000 % de rémunération en nature)				
3,000 % éch. 31/12/2026 (a)		552	327	0,02
DAE Funding LLC				
1,625 % éch. 15/02/2024	$	700	$ 665	0,05
3,375 % éch. 20/03/2028		3 300	2 934	0,22
Delta Air Lines, Inc.				
7,000 % éch. 01/05/2025		800	818	0,06
Discovery Communications LLC				
2,500 % éch. 20/09/2024	£	100	114	0,01
Exela Intermediate LLC				
11,500 % éch. 15/07/2026	$	218	38	0,00
Expedia Group, Inc.				
2,950 % éch. 15/03/2031		540	435	0,03
6,250 % éch. 01/05/2025		527	532	0,04
FactSet Research Systems, Inc.				
3,450 % éch. 01/03/2032		1 400	1 177	0,09
GE Capital UK Funding Unlimited Co.				
5,875 % éch. 18/01/2033	£	300	367	0,03
Greene King Finance PLC				
5,318 % éch. 15/09/2031		343	384	0,03
5,322 % éch. 15/12/2034		100	93	0,01
Grifols Escrow Issuer S.A.				
3,875 % éch. 15/10/2028	€	2 700	2 437	0,18
GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC				
3,375 % éch. 24/03/2027	$	1 000	932	0,07
GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC				
3,125 % éch. 24/03/2025		2 000	1 904	0,14
Hyatt Hotels Corp.				
1,800 % éch. 01/10/2024		900	844	0,06
Informa PLC				
1,250 % éch. 22/04/2028	€	1 500	1 361	0,10
1,500 % éch. 05/07/2023		237	251	0,02
InterContinental Hotels Group PLC				
2,125 % éch. 24/08/2026	£	200	209	0,02
2,125 % éch. 15/05/2027	€	700	689	0,05
John Lewis PLC				
4,250 % éch. 18/12/2034	£	1 300	952	0,07
6,125 % éch. 21/01/2025		350	405	0,03
Melco Resorts Finance Ltd.				
5,750 % éch. 21/07/2028	$	200	168	0,01
MGM China Holdings Ltd.				
5,250 % éch. 18/06/2025		200	188	0,01
5,875 % éch. 15/05/2026		200	187	0,01
Mileage Plus Holdings LLC				
6,500 % éch. 20/06/2027		104	103	0,01
Mitchells & Butlers Finance PLC				
5,219 % éch. 15/12/2030		126	117	0,01
6,013 % éch. 15/12/2030	£	1 440	1 619	0,12
6,469 % éch. 15/09/2032		400	439	0,03
Nissan Motor Co. Ltd.				
4,345 % éch. 17/09/2027	$	4 700	4 269	0,32
4,810 % éch. 17/09/2030		5 400	4 595	0,34
Penske Truck Leasing Co. LP				
3,950 % éch. 10/03/2025		800	771	0,06
Prosus NV				
1,207 % éch. 19/01/2026	€	1 000	964	0,07
2,085 % éch. 19/01/2030		1 300	1 084	0,08
RAC Bond Co. PLC				
4,565 % éch. 06/05/2046	£	100	119	0,01
Sabine Pass Liquefaction LLC				
5,000 % éch. 15/03/2027	$	500	491	0,04
5,750 % éch. 15/05/2024		200	200	0,01
5,875 % éch. 30/06/2026		1 000	1 013	0,08
Sands China Ltd.				
2,800 % éch. 08/03/2027		200	172	0,01
Sasol Financing USA LLC				
5,875 % éch. 27/03/2024		5 200	5 100	0,38
Scripps Escrow, Inc.				
3,875 % éch. 15/01/2029		1 000	804	0,06
Southern Co.				
3,700 % éch. 30/04/2030		800	724	0,05
Spirit AeroSystems, Inc.				
4,600 % éch. 15/06/2028		1 100	890	0,07
Studio City Finance Ltd.				
5,000 % éch. 15/01/2029		1 400	1 036	0,08
6,000 % éch. 15/07/2025		200	174	0,01
Targa Resources Corp.				
4,200 % éch. 01/02/2033		800	691	0,05
Tesco Corporate Treasury Services PLC				
0,375 % éch. 27/07/2029	€	900	$ 745	0,06
0,875 % éch. 29/05/2026		2 000	1 936	0,14
U.S. Airways Pass-Through Trust				
3,950 % éch. 15/05/2027	$	178	162	0,01
Ubisoft Entertainment S.A.				
0,878 % éch. 24/11/2027	€	1 000	828	0,06
Unigel Luxembourg S.A.				
8,750 % éch. 01/10/2026	$	200	199	0,01
United Airlines Pass-Through Trust				
2,700 % éch. 01/11/2033		1 061	859	0,06
United Airlines, Inc.				
4,375 % éch. 15/04/2026		800	743	0,05
4,625 % éch. 15/04/2029		400	349	0,03
Venture Global Calcasieu Pass LLC				
3,875 % éch. 01/11/2033		5 000	4 094	0,30
ViaSat, Inc.				
5,625 % éch. 15/09/2025		300	279	0,02
Virgin Media Secured Finance PLC				
4,250 % éch. 15/01/2030	£	1 800	1 689	0,13
Vmed O2 UK Financing PLC				
4,500 % éch. 15/07/2031		700	647	0,05
Warnermedia Holdings, Inc.				
3,528 % éch. 15/03/2024	$	4 000	3 878	0,29
Wynn Macau Ltd.				
5,500 % éch. 01/10/2027		200	175	0,01
5,625 % éch. 26/08/2028		1 100	942	0,07
Wynn Resorts Finance LLC				
7,750 % éch. 15/04/2025		300	299	0,02
			90 607	6,73
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
AES Corp.				
2,450 % éch. 15/01/2031		3 000	2 394	0,18
British Telecommunications PLC				
4,500 % éch. 04/12/2023		200	198	0,01
Électricité de France S.A.				
3,000 % éch. 03/09/2027 (f)	€	800	701	0,05
Georgia Power Co.				
2,100 % éch. 30/07/2023	$	3 080	3 027	0,23
Pacific Gas & Electric Co.				
1,700 % éch. 15/11/2023		400	387	0,03
2,100 % éch. 01/08/2027		1 900	1 626	0,12
3,150 % éch. 01/01/2026		1 300	1 209	0,09
3,450 % éch. 01/07/2025		200	189	0,01
3,500 % éch. 15/06/2025 ^		600	567	0,04
3,950 % éch. 01/12/2047 ^		200	136	0,01
4,000 % éch. 01/12/2046 ^		300	202	0,02
4,550 % éch. 01/07/2030		3 500	3 181	0,24
Rio Oil Finance Trust				
8,200 % éch. 06/04/2028		426	432	0,03
9,250 % éch. 06/07/2024		180	183	0,01
9,750 % éch. 06/01/2027		115	120	0,01
Southern California Edison Co.				
2,750 % éch. 01/02/2032		5 900	4 957	0,37
Sprint LLC				
7,625 % éch. 01/03/2026		800	844	0,06
Systems Energy Resources, Inc.				
2,140 % éch. 09/12/2025		700	641	0,05
			20 994	1,56
Total des Obligations et billets privés			316 849	23,54
OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX				
Obligations Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Bonds, Series 2021				
3,487 % éch. 01/06/2036		1 300	1 039	0,08
Billets Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, (ST APPROP Insured), Series 2021				
3,000 % éch. 01/06/2046		440	408	0,03
Billets Golden State, California Tobacco Securitization Corp. Revenue Notes, Series 2021				
2,587 % éch. 01/06/2029		4 000	3 353	0,25
Obligations Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2007				
0,000 % éch. 01/06/2047 (c)		4 700	350	0,02

Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Obligations Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020				
3,151 % éch. 01/06/2032	$	200	$ 160	0,01
3,401 % éch. 01/06/2034		1 150	892	0,07
3,501 % éch. 01/06/2035		1 700	1 301	0,10
			7 503	0,56
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Ginnie Mae				
3,500 % éch. 15/07/2045		17 979	16 768	1,24
Ginnie Mae, TBA				
2,500 % éch. 01/02/2053		7 100	6 161	0,46
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)				
3,500 % éch. 01/12/2047 - 01/07/2048		12 894	11 964	0,89
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				
2,500 % éch. 01/01/2053		11 900	10 079	0,75
3,000 % éch. 01/01/2053		19 000	16 679	1,24
3,500 % éch. 01/01/2053		139 800	127 080	9,44
			188 731	14,02
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Obligations du Trésor américain				
1,875 % éch. 15/02/2041		15 600	11 035	0,82
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e)				
2,500 % éch. 15/01/2029		42	43	0,00
Billets du Trésor américain				
0,250 % éch. 30/09/2025		24 400	21 912	1,63
0,375 % éch. 30/11/2025		15 600	13 956	1,04
1,250 % éch. 31/08/2024		37 300	35 317	2,62
1,750 % éch. 30/06/2024		21 600	20 702	1,54
1,875 % éch. 31/08/2024		650	622	0,05
2,125 % éch. 31/03/2024		610	591	0,04
2,125 % éch. 30/09/2024		87 000	83 503	6,21
2,125 % éch. 30/11/2024		520	498	0,04
2,250 % éch. 15/11/2024		3 340	3 208	0,24
2,375 % éch. 15/08/2024		550	531	0,04
2,500 % éch. 31/01/2024		870	850	0,06
2,875 % éch. 30/11/2023		750	738	0,05
			193 506	14,38
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,611 % éch. 25/11/2035 ^		286	221	0,02
American Home Mortgage Investment Trust				
4,969 % éch. 25/11/2045		1 508	1 303	0,10
Atlas Funding PLC				
3,894 % éch. 25/07/2058	£	817	975	0,07
Banc of America Funding Trust				
4,673 % éch. 20/02/2047	$	669	657	0,05
4,733 % éch. 20/07/2036		1 194	1 146	0,09
6,412 % éch. 25/10/2036 ^		8	7	0,00
Barley Hill PLC				
4,352 % éch. 27/08/2058	£	3 197	3 807	0,28
BCAP LLC Trust				
3,400 % éch. 26/11/2036	$	317	302	0,02
4,749 % éch. 25/03/2037		57	49	0,00
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
4,251 % éch. 25/01/2035		14	13	0,00
6,800 % éch. 25/02/2036		11	10	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,546 % éch. 25/09/2035 ^		83	36	0,00
Brass PLC				
3,965 % éch. 16/11/2066	£	1 516	1 826	0,14
5,344 % éch. 16/11/2066	$	441	441	0,03
Charter Mortgage Funding PLC				
3,935 % éch. 16/01/2057	£	151	180	0,01
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
3,790 % éch. 25/09/2035	$	5	4	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust				
3,048 % éch. 25/12/2035		48	39	0,00
4,669 % éch. 25/04/2047		321	279	0,02
4,709 % éch. 25/09/2047		37	32	0,00
4,809 % éch. 25/07/2046		12	11	0,00
4,993 % éch. 20/12/2035		967	844	0,06
5,500 % éch. 25/04/2035		1 056	747	0,06
5,750 % éch. 25/05/2036		72	33	0,00
6,000 % éch. 25/11/2036 ^	$	131	$ 77	0,01
6,000 % éch. 25/07/2037		433	231	0,02
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
5,750 % éch. 25/12/2035 ^		12	6	0,00
5,750 % éch. 25/02/2037 ^		504	249	0,02
5,750 % éch. 25/08/2037		627	347	0,03
6,000 % éch. 25/07/2036		271	154	0,01
6,500 % éch. 25/11/2036 ^		7	3	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				
3,276 % éch. 30/11/2037		7	7	0,00
Domi BV				
2,896 % éch. 15/06/2051	€	763	807	0,06
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust				
4,529 % éch. 19/10/2036	$	406	325	0,02
Dutch Property Finance BV				
2,228 % éch. 28/07/2054	€	355	375	0,03
EMF-UK PLC				
4,491 % éch. 13/03/2046	£	43	51	0,00
Eurohome UK Mortgages PLC				
3,946 % éch. 15/06/2044		99	114	0,01
European Loan Conduit DAC				
2,803 % éch. 17/02/2030	€	3 520	3 594	0,27
Eurosail PLC				
4,461 % éch. 13/06/2045	£	263	311	0,02
Finsbury Square PLC				
4,209 % éch. 16/03/2070		817	981	0,07
4,419 % éch. 16/12/2069		1 127	1 355	0,10
Friary PLC				
3,993 % éch. 21/11/2067		507	610	0,05
Great Hall Mortgages PLC				
3,685 % éch. 18/06/2039		81	95	0,01
3,695 % éch. 18/06/2038		42	49	0,00
GSMPS Mortgage Loan Trust				
4,739 % éch. 25/03/2035	$	95	90	0,01
GSR Mortgage Loan Trust				
6,000 % éch. 25/01/2037		1 229	840	0,06
HarborView Mortgage Loan Trust				
4,048 % éch. 19/10/2035		464	265	0,02
4,719 % éch. 19/01/2038		38	34	0,00
4,749 % éch. 19/12/2036		4 025	3 319	0,25
Harmony French Home Loans				
2,558 % éch. 27/05/2062	€	6 709	7 177	0,53
IndyMac Mortgage Loan Trust				
4,809 % éch. 25/07/2036	$	1 909	1 679	0,13
JPMorgan Alternative Loan Trust				
4,749 % éch. 25/06/2037		4 175	2 307	0,17
Jubilee Place BV				
2,378 % éch. 17/10/2057	€	1 725	1 827	0,14
Landmark Mortgage Securities PLC				
3,668 % éch. 17/04/2044	£	163	184	0,01
Lehman XS Trust				
4,789 % éch. 25/08/2046	$	193	172	0,01
4,839 % éch. 25/08/2046		371	348	0,03
Ludgate Funding PLC				
2,164 % éch. 01/12/2060	€	21	21	0,00
3,869 % éch. 01/12/2060	£	146	165	0,01
Mansard Mortgages PLC				
3,185 % éch. 15/04/2047		41	47	0,00
4,172 % éch. 15/12/2049		149	172	0,01
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				
6,639 % éch. 25/11/2034	$	863	832	0,06
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
3,188 % éch. 25/12/2037		1 089	726	0,05
6,354 % éch. 25/08/2036 ^		10 669	2 172	0,16
Mortgage Equity Conversion Asset Trust				
5,140 % éch. 25/05/2042		433	378	0,03
NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates				
6,500 % éch. 25/02/2035 ^		523	462	0,04
New Century Alternative Mortgage Loan Trust				
4,640 % éch. 25/10/2036		506	107	0,01
Newgate Funding PLC				
2,646 % éch. 15/12/2050	€	82	82	0,01
3,956 % éch. 15/12/2050	£	231	260	0,02
NovaStar Mortgage Funding Trust				
0,412 % éch. 25/09/2046	$	2 161	756	0,06
OBX Trust				
5,039 % éch. 25/06/2057	$	154	$ 146	0,01
Paragon Mortgages PLC				
4,290 % éch. 15/05/2045	£	452	541	0,04
Pepper Residential Securities Trust				
4,210 % éch. 16/09/2059	AUD	289	195	0,02
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
5,750 % éch. 25/06/2036 ^	$	22	17	0,00
6,000 % éch. 25/04/2036		1 001	772	0,06
6,000 % éch. 25/06/2036 ^		148	117	0,01
Residential Asset Securitization Trust				
6,500 % éch. 25/06/2037		2 896	730	0,05
RESIMAC Bastille Trust				
5,022 % éch. 05/12/2059		44	44	0,00
Ribbon Finance PLC				
3,826 % éch. 20/04/2028	£	187	219	0,02
RMAC PLC				
4,206 % éch. 12/06/2046		157	188	0,01
4,476 % éch. 12/06/2046		212	254	0,02
RMAC Securities PLC				
3,656 % éch. 12/06/2044		46	51	0,00
Shamrock Residential DAC				
2,744 % éch. 24/12/2059	€	2 352	2 471	0,18
2,744 % éch. 24/01/2061		3 598	3 751	0,28
Silverstone Master Issuer PLC				
3,701 % éch. 21/01/2070	£	1 488	1 793	0,13
Stratton BTL Mortgage Funding PLC				
3,656 % éch. 20/01/2054		10 174	11 942	0,89
Stratton Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2060		3 975	4 741	0,35
4,292 % éch. 25/09/2051		9 061	10 761	0,80
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
4,609 % éch. 25/09/2047	$	709	574	0,04
Towd Point Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2045	£	1 411	1 679	0,13
4,071 % éch. 20/10/2051		4 279	5 117	0,38
4,190 % éch. 20/02/2045		280	332	0,03
4,471 % éch. 20/02/2054		939	1 126	0,08
Trinidad Mortgage Securities PLC				
3,900 % éch. 24/01/2059		42	50	0,00
Twin Bridges PLC				
4,237 % éch. 12/03/2055		8 292	9 757	0,73
4,386 % éch. 12/09/2050		172	207	0,02
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,290 % éch. 25/02/2037 ^	$	74	67	0,01
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
4,989 % éch. 25/07/2036 ^		102	56	0,00
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				
3,615 % éch. 25/07/2034		10	10	0,00
			104 833	7,79
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Accredited Mortgage Loan Trust				
4,649 % éch. 25/09/2036		576	566	0,04
5,334 % éch. 25/09/2035		1 500	1 284	0,10
Accunia European CLO DAC				
2,328 % éch. 15/07/2030	€	2 586	2 705	0,20
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
4,669 % éch. 25/07/2036	$	100	75	0,01
4,689 % éch. 25/07/2036		1 049	394	0,03
5,004 % éch. 25/12/2035		2 800	2 475	0,18
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,094 % éch. 25/11/2035		1 270	1 245	0,09
5,259 % éch. 25/01/2036		3 400	3 197	0,24
5,409 % éch. 25/09/2034		1 407	1 373	0,10
Apidos CLO				
5,253 % éch. 20/04/2031		1 000	986	0,07
Ares European CLO DAC				
2,306 % éch. 20/04/2032	€	2 500	2 592	0,19
Argent Mortgage Loan Trust				
4,869 % éch. 25/05/2035	$	79	70	0,01
Argent Securities Trust				
4,609 % éch. 25/05/2036		167	42	0,00
4,689 % éch. 25/07/2036		108	94	0,01

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				
5,169 % éch. 15/01/2031	$	3 045	$ 2 987	0,22
Aurium CLO DAC				
2,108 % éch. 16/01/2031	€	4 698	4 904	0,37
3,152 % éch. 23/03/2032		5 000	5 222	0,39
Bain Capital Euro CLO DAC				
2,602 % éch. 24/01/2033		2 000	2 086	0,16
Barings CLO Ltd.				
5,043 % éch. 20/01/2028	$	1 478	1 472	0,11
Bayview Financial Acquisition Trust				
6,596 % éch. 28/12/2036		440	444	0,03
BBVA Consumer Auto				
0,270 % éch. 20/07/2031	€	781	815	0,06
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
4,619 % éch. 25/02/2037	$	3 000	2 744	0,20
5,019 % éch. 25/02/2036		1 233	1 230	0,09
5,034 % éch. 25/12/2035		54	54	0,00
5,244 % éch. 25/07/2034		1 409	1 348	0,10
5,409 % éch. 25/10/2035		371	358	0,03
5,439 % éch. 25/08/2037		842	754	0,06
Black Diamond CLO DAC				
2,778 % éch. 15/05/2032	€	4 600	4 760	0,35
2,834 % éch. 03/10/2029		60	64	0,01
Blackrock European CLO DAC				
1,998 % éch. 15/10/2031		5 400	5 588	0,42
Cairn CLO DAC				
2,275 % éch. 31/01/2030		614	642	0,05
2,333 % éch. 25/07/2029		86	91	0,01
2,688 % éch. 20/10/2028		72	76	0,01
Carlyle Euro CLO DAC				
2,428 % éch. 15/08/2030		2 890	3 010	0,22
Carlyle Global Market Strategies CLO Ltd.				
5,179 % éch. 15/10/2030	$	1 691	1 674	0,13
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.				
2,548 % éch. 15/11/2031	€	800	827	0,06
CBAM CLO Ltd.				
5,493 % éch. 20/07/2030	$	2 293	2 270	0,17
Cedar Funding CLO Ltd.				
5,223 % éch. 20/04/2031		1 100	1 085	0,08
5,243 % éch. 20/01/2031		5 050	4 992	0,37
CIFC Funding Ltd.				
5,043 % éch. 20/01/2028		740	734	0,06
5,194 % éch. 18/04/2031		700	688	0,05
CIT Mortgage Loan Trust				
5,889 % éch. 25/10/2037		5 500	5 237	0,39
Citigroup Mortgage Loan Trust				
4,449 % éch. 25/07/2045		400	285	0,02
4,539 % éch. 25/12/2036		101	42	0,00
4,559 % éch. 25/07/2045		7 446	5 343	0,40
7,250 % éch. 25/05/2036		875	457	0,03
Citigroup Mortgage Loan Trust Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,334 % éch. 25/10/2034		54	52	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
4,649 % éch. 25/03/2037		3 072	2 610	0,19
Contego CLO BV				
2,148 % éch. 15/10/2030	€	1 599	1 668	0,12
Contego CLO DAC				
2,142 % éch. 23/01/2030		3 993	4 153	0,31
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,083 % éch. 25/05/2036	$	3 083	3 034	0,23
4,529 % éch. 25/06/2035		3 428	3 097	0,23
4,569 % éch. 25/11/2047 ^		1 019	1 120	0,08
4,589 % éch. 25/06/2047 ^		2 890	2 474	0,18
4,599 % éch. 25/05/2047 ^		74	66	0,01
4,609 % éch. 25/09/2037 ^		388	398	0,03
5,049 % éch. 25/08/2035		350	340	0,03
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				
3,024 % éch. 25/12/2036 ^		163	128	0,01
5,304 % éch. 25/01/2034		491	459	0,03
CVC Cordatus Loan Fund DAC				
2,112 % éch. 21/07/2030	€	4 052	4 239	0,32
2,138 % éch. 15/04/2032		3 498	3 631	0,27
2,578 % éch. 15/08/2032		5 500	5 722	0,43
Dryden Euro CLO DAC				
2,038 % éch. 15/04/2033		4 500	4 660	0,35
2,228 % éch. 15/07/2031		581	606	0,05
Elevation CLO Ltd.				
5,355 % éch. 15/10/2029	$	1 681	$ 1 670	0,12
Ellington Loan Acquisition Trust				
5,489 % éch. 25/05/2037		3 437	3 303	0,25
Euro-Galaxy CLO DAC				
1,958 % éch. 11/04/2031	€	1 200	1 250	0,09
Fieldstone Mortgage Investment Trust				
4,696 % éch. 25/04/2047	$	2 077	1 470	0,11
Fremont Home Loan Trust				
4,524 % éch. 25/10/2036		154	136	0,01
4,589 % éch. 25/08/2036		215	75	0,01
5,259 % éch. 25/05/2034		1 419	1 308	0,10
GE-WMC Mortgage Securities Trust				
4,689 % éch. 25/08/2036		5 218	2 345	0,17
Greenwood Park CLO Ltd.				
5,109 % éch. 15/04/2031		1 250	1 232	0,09
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.				
5,498 % éch. 15/09/2037		3 485	3 432	0,26
GSAA Home Equity Trust				
5,772 % éch. 25/11/2036 ^		476	146	0,01
5,985 % éch. 25/06/2036		1 363	364	0,03
GSAMP Trust				
4,529 % éch. 25/11/2036		1 949	940	0,07
4,909 % éch. 25/02/2046		558	510	0,04
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
5,169 % éch. 25/01/2036		2 200	1 892	0,14
ICG U.S. CLO Ltd.				
5,405 % éch. 22/07/2031		5 200	5 089	0,38
Jubilee CLO DAC				
2,128 % éch. 12/07/2028	€	240	256	0,02
2,846 % éch. 15/12/2029		2 055	2 152	0,16
LCM LP				
5,283 % éch. 20/10/2027	$	284	283	0,02
Lehman XS Trust				
5,709 % éch. 25/03/2037		2 003	1 919	0,14
LoanCore Issuer Ltd.				
5,358 % éch. 17/01/2037		500	485	0,04
Long Beach Mortgage Loan Trust				
4,829 % éch. 25/02/2036		366	353	0,03
5,304 % éch. 25/08/2035		4 270	3 822	0,28
Madison Park Funding Ltd.				
5,155 % éch. 22/04/2027		836	828	0,06
Man GLG Euro CLO DAC				
2,058 % éch. 15/10/2030	€	2 816	2 936	0,22
2,248 % éch. 15/01/2030		572	596	0,04
2,462 % éch. 15/05/2031		499	520	0,04
Marathon CLO Ltd.				
5,545 % éch. 21/11/2027	$	17	17	0,00
Midocean Credit CLO				
5,347 % éch. 19/07/2028		682	679	0,05
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
4,459 % éch. 25/10/2036		1 455	697	0,05
4,519 % éch. 25/11/2036		1 684	783	0,06
4,529 % éch. 25/05/2037		1 420	1 244	0,09
4,619 % éch. 25/10/2036		1 179	586	0,04
4,619 % éch. 25/11/2036		5 280	3 192	0,24
4,639 % éch. 25/07/2036		434	367	0,03
4,689 % éch. 25/09/2036		15 216	5 838	0,43
4,889 % éch. 25/04/2036		105	98	0,01
4,929 % éch. 25/12/2034		1 362	1 205	0,09
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust				
4,899 % éch. 25/02/2036		1 800	1 618	0,12
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
6,226 % éch. 25/10/2036 ^		277	86	0,01
Mountain View CLO Ltd.				
4,761 % éch. 13/10/2027		317	317	0,02
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust				
4,789 % éch. 25/02/2037 ^		3 226	1 025	0,08
NovaStar Mortgage Funding Trust				
4,549 % éch. 25/09/2037		20	20	0,00
4,709 % éch. 25/05/2036		49	47	0,00
Oak Hill European Credit Partners DAC				
2,186 % éch. 20/01/2032	€	785	819	0,06
Option One Mortgage Loan Trust				
4,529 % éch. 25/01/2037	$	52	31	0,00
4,529 % éch. 25/02/2037		630	424	0,03
4,529 % éch. 25/03/2037	$	770	$ 689	0,05
4,609 % éch. 25/04/2037		601	439	0,03
4,609 % éch. 25/05/2037		664	405	0,03
OZLM Ltd.				
5,099 % éch. 15/04/2031		2 400	2 340	0,17
5,159 % éch. 17/04/2031		985	963	0,07
5,393 % éch. 20/01/2031		1 800	1 771	0,13
OZLME DAC				
2,397 % éch. 27/07/2032	€	2 200	2 296	0,17
Palmer Square European Loan Funding DAC				
3,993 % éch. 12/04/2032		5 000	5 306	0,39
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust				
4,884 % éch. 25/07/2036	$	685	639	0,05
RAAC Trust				
5,149 % éch. 25/10/2046		101	96	0,01
Residential Asset Securities Corp. Trust				
4,729 % éch. 25/11/2036		47	44	0,00
4,974 % éch. 25/03/2036		1 129	1 110	0,08
Sculptor European CLO DAC				
2,153 % éch. 14/01/2032	€	5 000	5 193	0,39
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
4,709 % éch. 25/10/2036	$	9 878	3 519	0,26
5,049 % éch. 25/08/2035 ^		57	44	0,00
Segovia European CLO DAC				
2,336 % éch. 20/07/2032	€	6 900	7 130	0,53
SG Mortgage Securities Trust				
4,599 % éch. 25/10/2036	$	3 600	2 457	0,18
Sierra Madre Funding Ltd.				
4,597 % éch. 07/09/2039		2 185	1 621	0,12
Sound Point CLO Ltd.				
5,344 % éch. 18/04/2031		7 400	7 242	0,54
5,427 % éch. 26/07/2031		1 000	974	0,07
Soundview Home Loan Trust				
4,589 % éch. 25/06/2037		2 306	1 666	0,12
4,649 % éch. 25/02/2037		1 017	298	0,02
4,889 % éch. 25/10/2036		1 477	1 401	0,10
Structured Asset Investment Loan Trust				
5,364 % éch. 25/01/2035		1 685	1 518	0,11
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
4,544 % éch. 25/09/2036		4 855	3 069	0,23
5,620 % éch. 25/04/2035		39	38	0,00
TICP CLO Ltd.				
5,083 % éch. 20/04/2028		932	929	0,07
Toro European CLO DAC				
2,298 % éch. 15/07/2030	€	351	369	0,03
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				
4,614 % éch. 25/05/2037	$	501	457	0,03
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
4,689 % éch. 25/04/2037		4 701	3 196	0,24
6,114 % éch. 25/11/2035		100	98	0,01
			233 560	17,36
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement argentin				
0,500 % éch. 09/07/2030		1 422	385	0,03
1,000 % éch. 09/07/2029		150	40	0,00
1,500 % éch. 09/07/2035		2 504	636	0,05
Obligation internationale du gouvernement israélien				
2,750 % éch. 03/07/2030		1 900	1 730	0,13
3,800 % éch. 13/05/2060		2 000	1 573	0,12
Japan Finance Organization for Municipalities				
0,050 % éch. 12/02/2027	€	1 500	1 394	0,10
Letras de la Nacion Argentina con Ajuste por CER				
0,000 % éch. 19/05/2023 (c)	ARS	27 893	85	0,01
Obligation internationale du gouvernement péruvien				
5,940 % éch. 12/02/2029	PEN	33 832	8 145	0,60
6,350 % éch. 12/08/2028		32 446	8 096	0,60
Obligation internationale du gouvernement roumain				
1,750 % éch. 13/07/2030	€	1 500	1 118	0,08
Obligation internationale du gouvernement russe				
4,250 % éch. 23/06/2027 ^	$	200	70	0,01
4,750 % éch. 27/05/2026 ^		200	70	0,01
5,100 % éch. 28/03/2035 ^		400	132	0,01
5,250 % éch. 23/06/2047 ^		600	222	0,02
Obligation internationale du gouvernement sud-africain				
4,850 % éch. 30/09/2029		2 000	1 790	0,13

Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Obligation internationale du gouvernement turc			
5,750 % éch. 22/03/2024	$ 1 000	$ 993	0,07
6,350 % éch. 10/08/2024	2 500	2 477	0,18
		28 956	2,15

	ACTIONS		
ACTIONS ORDINAIRES			
ÉNERGIE			
Constellation Oil Services Holding S.A. « B » (b)(i)	617 385	67	0,01
TITRES PRIVILÉGIÉS			
Nationwide Building Society 10,250 %	2 850	429	0,03

	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BONS DU TRÉSOR HONGROIS			
18,250 % éch. 03/01/2023 (c)(d)	HUF 3 083 000	8 217	0,61

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS			
(0,190) % éch. 20/03/2023 (c)(d)	¥ 13 120 000	$ 99 472	7,39
Total des Instruments à court terme		107 689	8,00
Total des Valeurs mobilières		**$ 1 216 746**	**90,41**

	ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (g)	1 197 507	10 538	0,79
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (g)	385 356	3 518	0,26

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (g)	5 839 300	$ 58 125	4,32
		72 181	5,37
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (g)	614 500	60 875	4,52
Total des Fonds d'investissement		**$ 133 056**	**9,89**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
FICC	4,280 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 118 800	Billets du Trésor américain 4,275 % échéance 30/04/2024	$ (121 176)	$ 118 800	$ 118 856	8,83
Total des Contrats de mise en pension						**$ (121 176)**	**$ 118 800**	**$ 118 856**	**8,83**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2024	2 036	$ 9 575	0,71
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	21	17	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Court	03/2023	289	1 046	0,08
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	Long	03/2023	237	(2 044)	(0,15)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	176	1 604	0,12
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	Long	03/2023	16	(437)	(0,03)
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	21	(107)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Long	03/2023	1 025	(1 078)	(0,08)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Court	03/2023	239	(4)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Court	03/2023	131	340	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	446	358	0,03
				$ 9 270	0,69

(1) Option de style contrat à terme standardisé.

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Nbre de Contrats	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	$ 98,000	15/12/2023	133	$ 0	$ (12)	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	133	0	(403)	(0,03)
				$ 0	$ (415)	(0,03)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					**$ 8 855**	**0,66**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AT&T, Inc.	1,000 %	20/06/2024	$ 3 200	$ 7	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	1 900	(34)	0,00
Ford Motor Credit Co. LLC	5,000	20/06/2027	500	8	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	1 700	(1)	0,00
				$ (20)	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION[2]

Indices/Tranches	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.HY-34 à 5 ans	(5,000) %	20/06/2025	$ 20 930	$ (1 696)	(0,13)
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	(5,000)	20/12/2027	11 100	(235)	(0,02)
Indice iTraxx Europe Main 32 à 5 ans	(1,000)	20/12/2024	€ 200	3	0,00
				$ (1 928)	(0,15)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.HY-37 à 5 ans	5,000 %	20/12/2026	$ 396	$ (18)	0,00
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000	20/12/2027	1 700	14	0,00
				$ (4)	0,00

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	0,500 %	07/02/2023	£ 53 000	$ (754)	(0,06)
À payer[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2033	21 100	562	0,04
À recevoir[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250	15/03/2028	32 300	1 163	0,09
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	21/12/2052	$ 49 700	3 321	0,25
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,853	18/05/2032	49 800	(6 528)	(0,49)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,350	14/12/2032	10 600	235	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	11,055	04/01/2027	BRL 18 600	(150)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,086	04/01/2027	114 100	(924)	(0,07)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,098	04/01/2027	132 600	(1 066)	(0,08)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,734	02/01/2025	112 000	(367)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,800	02/01/2025	111 000	(340)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,814	04/01/2027	69 000	(281)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,835	02/01/2025	111 000	(328)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,868	04/01/2027	14 300	(54)	0,00
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,000	14/11/2023	CAD 44 700	(933)	(0,07)
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,060	28/10/2023	193 100	(3 976)	(0,30)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	1,750	15/12/2026	KRW 135 049 300	(7 328)	(0,54)
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	1,750	15/12/2031	69 068 100	6 796	0,51
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	2,000	15/12/2026	90 071 300	(3 722)	(0,28)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	2,000	15/12/2031	40 820 400	3 187	0,24
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,000	01/11/2023	NZD 120 200	(1 642)	(0,12)
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,000	15/12/2023	139 900	(2 057)	(0,15)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,500	16/06/2026	$ 83 700	(7 984)	(0,59)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	17/06/2030	5 000	721	0,05
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,270	04/11/2023	335 700	(11 696)	(0,87)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	18/12/2029	1 210	140	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	10/12/2029	5 100	606	0,05
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	12/02/2030	9 900	1 324	0,10
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	10/03/2030	4 900	569	0,04
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,250	20/06/2028	14 860	437	0,03
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	€ 300	3	0,00
À recevoir[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028	18 900	871	0,06
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	6 540	(30)	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,985	11/10/2027	PLN 83 000	(587)	(0,04)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	7,015	11/10/2027	64 100	(472)	(0,04)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	7,156	13/10/2027	42 800	(374)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,660	24/03/2023	MXN 345 970	(215)	(0,02)
					$ (31 873)	(2,37)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ (33 825)**	**(2,52)**

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	0,023 %	29/06/2023	14 900	$ 792	$ 3 262	0,24
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	0,021	25/10/2023	6 200	354	1 563	0,12
FAR	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	0,021	15/09/2023	10 500	551	2 533	0,19
MYC	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	0,021	15/09/2023	11 000	598	2 711	0,20
							$ 2 295	$ 10 069	0,75

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente - Indice iTraxx Europe 37 à 5 ans hors cote	Vente	3,000 %	15/03/2023	14 400	$ (26)	$ (2)	0,00

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	0,021 %	29/06/2023	73 000	$ (793)	$ (5 725)	(0,43)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	0,020	25/10/2023	31 000	(355)	(2 443)	(0,18)
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	31/03/2023	160 800	(268)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	31/03/2023	160 800	(354)	(2 469)	(0,18)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	28/04/2023	11 300	(20)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	28/04/2023	11 300	(20)	(160)	(0,01)
FAR	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	0,020	15/09/2023	52 500	(551)	(4 240)	(0,32)
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	4 600	(30)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	4 600	(30)	(59)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	4 600	(32)	(7)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	4 600	(32)	(54)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	4 600	(32)	(7)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	4 600	(32)	(52)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	4 600	(32)	(7)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	4 600	(32)	(51)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	4 600	(32)	(6)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	4 600	(32)	(60)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	4 700	(32)	(5)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	4 700	(32)	(66)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	24 600	(89)	(17)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	24 600	(89)	(176)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	36 100	(126)	(23)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/11/2023	36 100	(126)	(280)	(0,02)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	13 300	(41)	(11)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	13 300	(42)	(92)	(0,01)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,500	07/02/2023	355 800	(1 228)	(10 605)	(0,79)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	26/04/2023	11 000	(19)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	26/04/2023	11 000	(19)	(156)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	4 800	(56)	(12)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	4 800	(66)	(157)	(0,01)
MYC	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	0,020	15/09/2023	55 000	(598)	(4 494)	(0,33)
							$ (5 240)	$ (31 440)	(2,34)

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	$ 101,891	05/01/2023	2 400	$ (7)	$ 0	0,00
SAL	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	97,578	06/03/2023	2 800	(22)	(26)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	99,578	06/03/2023	2 800	(20)	(21)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	101,859	05/01/2023	2 000	(6)	0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	99,750	06/02/2023	1 300	(9)	(8)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	100,000	06/02/2023	4 700	(32)	(33)	(0,01)
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	101,750	06/02/2023	1 300	(8)	(3)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	102,000	06/02/2023	4 700	(28)	(8)	0,00
					$ (132)	$ (99)	(0,01)

(1) Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	UBS AG	(1,000) %	20/06/2024	$ 200	$ 13	$ (14)	$ (1)	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[2]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BRC	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000 %	20/06/2024	$ 200	$ (26)	$ 17	$ (9)	0,00
GLM	Petrobras Global Finance BV	1,000	20/12/2023	1 200	(88)	88	0	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2024	200	(3)	2	(1)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/06/2024	2 300	(102)	98	(4)	0,00
HUS	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2024	400	(12)	12	0	0,00
					$ (231)	$ 217	$ (14)	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[2]

Contrepartie	Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500 %	17/11/2059	$ 2 200	$ (9)	$ 4	$ (5)	0,00
MYC	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	100	(4)	4	0	0,00
SAL	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	1 500	(3)	0	(3)	0,00
UAG	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	300	(9)	8	(1)	0,00
					$ (25)	$ 16	$ (9)	0,00

(1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	1,000 %	15/12/2026	THB 5 052 060	$ 6 599	$ 54	$ 6 653	0,49
	À payer	THORON THB composé-OIS à 3 mois	1,500	15/12/2031	2 436 270	(5 559)	29	(5 530)	(0,41)
GLM	À payer	THBFIX THB à 6 mois	1,500	15/12/2031	15 800	(11)	(27)	(38)	0,00
						$ 1 029	$ 56	$ 1 085	0,08

Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite)

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	HUF	558 172	$	1 425	$ 0	$ (63)	$ (63)	0,00
	01/2023	PEN	2 080		541	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	PLN	1 291		294	0	0	0	0,00
	01/2023	$	216	PLN	958	2	0	2	0,00
	01/2023		657	ZAR	11 669	28	0	28	0,00
	02/2023		541	PEN	2 087	4	0	4	0,00
	02/2023		1 246	ZAR	22 325	62	0	62	0,01
	03/2023		1 388		24 515	44	0	44	0,00
BPS	01/2023	HUF	748 809	$	1 958	0	(38)	(38)	0,00
	01/2023	$	773	€	724	0	0	0	0,00
	03/2023	CLP	5 695 075	$	5 898	0	(715)	(715)	(0,05)
	03/2023	MXN	20 290		1 007	0	(20)	(20)	0,00
	03/2023	$	2 645	CNY	18 278	12	0	12	0,00
BRC	01/2023	CNH	2 226	$	319	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	HUF	1 596 059		4 162	0	(92)	(92)	(0,01)
	01/2023	$	1 606	£	1 334	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		469	PLN	2 079	6	(1)	5	0,00
	02/2023		204	ZAR	3 378	0	(6)	(6)	0,00
CBK	01/2023	BRL	86 014	$	16 424	133	0	133	0,01
	01/2023	CLP	5 726 680		6 437	0	(279)	(279)	(0,02)
	01/2023	PEN	16 070		4 065	0	(143)	(143)	(0,01)
	01/2023	PLN	9 794		2 139	0	(93)	(93)	(0,01)
	01/2023	$	16 388	BRL	86 014	0	(97)	(97)	(0,01)
	01/2023		6 008	CLP	5 724 749	706	0	706	0,05
	01/2023		1 516	PEN	5 831	12	0	12	0,00
	01/2023		4 329	PLN	20 049	239	0	239	0,02
	02/2023	BRL	17 762	$	3 291	0	(55)	(55)	0,00
	02/2023	NZD	4 739		2 875	0	(124)	(124)	(0,01)
	02/2023	PEN	12 459		3 124	0	(133)	(133)	(0,01)
	02/2023	$	16 323	BRL	86 014	0	(120)	(120)	(0,01)
	02/2023		6 437	CLP	5 758 223	284	0	284	0,02
	04/2023	PEN	40 966	$	10 268	0	(381)	(381)	(0,03)
	05/2023		12 629		3 183	0	(93)	(93)	(0,01)
CLY	01/2023	HUF	162 417		413	0	(20)	(20)	0,00
GLM	01/2023	CNH	2 310		332	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	PLN	106 448		21 126	0	(3 127)	(3 127)	(0,23)
	01/2023	$	734	PEN	2 953	39	0	39	0,00
	01/2023		1 436	PLN	6 757	103	0	103	0,01
	01/2023		1 276	ZAR	22 807	63	0	63	0,01
	02/2023		2 211	COP	10 070 699	0	(153)	(153)	(0,01)
	03/2023	MXN	41 612	$	2 024	0	(82)	(82)	(0,01)
	05/2023	PEN	50 447		12 678	0	(411)	(411)	(0,03)
	05/2023	$	2 622	PEN	10 610	133	0	133	0,01
	05/2023		354	ZAR	5 921	0	(10)	(10)	0,00
MBC	01/2023	CAD	1 154	$	860	9	0	9	0,00
	01/2023	€	209 765		219 852	0	(4 116)	(4 116)	(0,31)
	01/2023	$	101	AUD	151	1	0	1	0,00
	01/2023		7 151	¥	973 920	235	0	235	0,02
	01/2023		945	PLN	4 792	147	0	147	0,01
	05/2023		653	CNH	4 383	0	(13)	(13)	0,00
MYI	01/2023	£	362	$	435	0	0	0	0,00
	01/2023	PLN	6 472		1 370	0	(105)	(105)	(0,01)
	01/2023	$	3 216	AUD	4 789	32	0	32	0,00
	01/2023		25	€	24	0	0	0	0,00
	01/2023		1 380	£	1 145	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023		6 109	¥	836 817	238	0	238	0,02
	01/2023		1 826	PLN	9 156	260	0	260	0,02
	01/2023		830	ZAR	14 886	44	0	44	0,00
	02/2023	TWD	1 106	$	36	0	0	0	0,00
	02/2023	$	830	ZAR	14 914	43	0	43	0,00
RBC	01/2023	¥	6 614	$	49	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$	37	AUD	55	0	0	0	0,00
	03/2023		3	MXN	54	0	0	0	0,00
	04/2023	MXN	12 717	$	613	0	(26)	(26)	0,00
RYL	01/2023	€	3 201		3 393	0	(25)	(25)	0,00
SCX	01/2023	$	216	AUD	321	1	0	1	0,00
	01/2023		1 483	£	1 198	0	(42)	(42)	0,00
	01/2023		5 087	PEN	19 594	48	0	48	0,00
	02/2023	NZD	1 227	$	746	0	(31)	(31)	0,00
	02/2023	TWD	1 970		64	0	0	0	0,00
SSB	01/2023	PEN	5 622		1 456	0	(17)	(17)	0,00
	01/2023	$	1 456	PEN	5 622	17	0	17	0,00
	03/2023	¥	13 120 000	$	97 813	0	(2 629)	(2 629)	(0,19)
TOR	01/2023	£	83 080		99 886	0	(67)	(67)	(0,01)
UAG	01/2023	HUF	6 136		16	0	0	0	0,00
	01/2023	$	128	PLN	565	0	0	0	0,00
	03/2023		836	ZAR	14 934	36	0	36	0,00
						$ 2 981	$ (13 342)	$ (10 361)	(0,77)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BPS	01/2023	$ 16	€ 15	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
CBK	01/2023	€ 425	$ 450	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	$ 14 573	€ 14 056	435	0	435	0,03
MBC	01/2023	€ 46	$ 49	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 15 158	€ 14 457	278	0	278	0,02
SCX	01/2023	14 630	14 056	378	0	378	0,03
				$ 1 091	$ (4)	$ 1 087	0,08

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 1	$ 2	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$ 432 689	£ 358 563	0	(1 304)	(1 304)	(0,09)
BPS	01/2023	£ 2 654	$ 3 199	7	0	7	0,00
BRC	01/2023	1 141	1 374	1	0	1	0,00
	01/2023	$ 430	£ 358	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	£ 1	$ 2	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 395 636	£ 330 110	1 689	(173)	1 516	0,11
MYI	01/2023	£ 63	$ 77	1	0	1	0,00
	01/2023	$ 7	£ 5	0	0	0	0,00
TOR	01/2023	385 980	321 038	258	0	258	0,02
UAG	01/2023	£ 199	$ 246	7	0	7	0,00
				$ 1 963	$ (1 477)	$ 486	0,04

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ (29 199)**	**(2,17)**

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 2,000 % éch. 01/02/2053	$ 115 500	$ (94 108)	(6,99)
Total des Titres vendus à découvert		**$ (94 108)**	**(6,99)**
Total des Investissements		**$ 1 320 325**	**98,11**
Autres actifs et passifs à court terme		**$ 25 456**	**1,89**
Actif net		**$ 1 345 781**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à rémunération en nature.

(b) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(e) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

(f) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(g) Affilié au Fonds.

(h) Titre convertible conditionnel.

(i) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,00 %) :

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Constellation Oil Services Holding S.A. « B »	06/10/2022	$ 67	$ 67	0,00
Deutsche Bank AG 3,729 % échéance 14/01/2023	11/01/2021 - 24/02/2021	2 202	1 617	0,12
		$ 2 269	$ 1 684	0,12

Un titre d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 1 087 $) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 29 843 $ (31 décembre 2021 : 29 150 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 1 772 $) et un montant en numéraire de 27 963 $ (31 décembre 2021 : 631 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 1 216 185	$ 561	$ 1 216 746
Fonds d'investissement	72 181	60 875	0	133 056
Contrats de mise en pension	0	118 800	0	118 800
Instruments financiers dérivés[3]	79	(54 248)	0	(54 169)
Titres vendus à découvert	0	(94 108)	0	(94 108)
Totaux	**$ 72 260**	**$ 1 247 504**	**$ 561**	**$ 1 320 325**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 2 782 550	$ 4 246	$ 2 786 796
Fonds d'investissement	312 142	0	0	312 142
Contrats de mise en pension	0	72 663	0	72 663
Instruments financiers dérivés[3]	(1 587)	23 278	0	21 691
Titres vendus à découvert	0	(253 414)	0	(253 414)
Totaux	**$ 310 555**	**$ 2 625 077**	**$ 4 246**	**$ 2 939 878**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ S/O	$ S/O	$ S/O	$ 45	$ 0	$ 45
BOA	(3 452)	3 430	(22)	4 340	(4 050)	290
BPS	(3 383)	3 100	(283)	(253)	30	(223)
BRC	(105)	30	(75)	288	0	288
CBK	287	(540)	(253)	(1 013)	933	(80)
CLY	(20)	0	(20)	S/O	S/O	S/O
FAR	(1 707)	1 460	(247)	(172)	280	108
GLM	(15 394)	15 157	(237)	(118)	839	721
GST	(12)	22	10	(28)	0	(28)
HUS	S/O	S/O	S/O	590	(370)	220
MBC	(1 943)	1 280	(663)	S/O	S/O	S/O
MYC	(1 783)	1 490	(293)	(178)	280	102
MYI	510	(320)	190	15 963	(12 640)	3 323
RBC	(28)	0	(28)	138	0	138
RYL	(25)	0	(25)	S/O	S/O	S/O
SAL	(102)	94	(8)	(52)	41	(11)
SCX	354	(460)	(106)	11 660	(10 840)	820
SSB	(2 629)	1 900	(729)	157	0	157
TOR	191	(750)	(559)	49	0	49
UAG	42	(20)	22	11 656	(8 420)	3 236

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	44,59	44,94
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	43,14	39,48
Autres valeurs mobilières	2,68	2,20
Fonds d'investissement	9,89	9,70
Contrats de mise en pension	8,83	2,26
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,66	(0,09)
Instruments financiers dérivés compensés	(2,52)	(0,58)
Instruments financiers dérivés hors cote	(2,17)	1,34
Titres vendus à découvert	(6,99)	(7,87)
Contrats de prise en pension	S/O	(0,03)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Crédits consortiaux et cessions	2,57	1,55
Obligations et billets privés	23,54	27,44
Obligations et billets municipaux	0,56	0,23
Agences du gouvernement américain	14,02	1,40
Obligations du Trésor américain	14,38	14,78
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	7,79	4,45
Titres adossés à des actifs	17,36	8,35
Émissions souveraines	2,15	2,74
Actions ordinaires	0,01	S/O
Titres privilégiés	0,03	0,02
Instruments à court terme	8,00	25,66
Fonds d'investissement	9,89	9,70
Contrats de mise en pension	8,83	2,26
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,69	(0,09)
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,03)	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection	(0,15)	(0,09)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,00	0,01
Swaps de taux d'intérêt	(2,37)	(0,50)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,75	0,06
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(2,34)	(0,13)
Options sur titres	(0,01)	(0,00)
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,00	0,00
Swaps de taux d'intérêt	0,08	0,01
Contrats de change à terme	(0,77)	(0,25)
Contrats de change à terme couverts	0,12	1,65
Titres vendus à découvert	(6,99)	(7,87)
Autres actifs et passifs à court terme	1,89	8,62
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES					
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS					
CenturyLink, Inc.					
6,634 % éch. 15/03/2027	$	20	$	19	0,39
CommScope, Inc.					
7,634 % éch. 06/04/2026		20		19	0,39
Hilton Domestic Operating Co., Inc.					
6,173 % éch. 22/06/2026		20		20	0,41
U.S. Foods, Inc.					
7,134 % éch. 22/11/2028		18		17	0,34
				75	1,53
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
BANQUE ET FINANCE					
Aflac, Inc.					
1,125 % éch. 15/03/2026		19		17	0,35
Alexandria Real Estate Equities, Inc.					
2,950 % éch. 15/03/2034		14		11	0,22
American Tower Corp.					
1,450 % éch. 15/09/2026		36		32	0,65
Bank of America Corp.					
2,456 % éch. 22/10/2025		52		49	0,99
Bank of Nova Scotia					
5,245 % éch. 11/03/2024		48		48	0,97
Citigroup, Inc.					
4,615 % éch. 25/01/2026 (c)		50		49	0,99
Corebridge Financial, Inc.					
3,850 % éch. 05/04/2029		18		17	0,35
Deutsche Bank AG					
1,375 % éch. 10/06/2026	€	25		25	0,51
Equinix, Inc.					
1,000 % éch. 15/09/2025	$	28		25	0,51
1,550 % éch. 15/03/2028		30		25	0,51
Equitable Financial Life Global Funding					
1,300 % éch. 12/07/2026		28		24	0,49
Banque européenne d'investissement					
2,375 % éch. 24/05/2027		67		62	1,26
Goldman Sachs Group, Inc.					
4,387 % éch. 15/06/2027		49		47	0,95
HAT Holdings LLC					
3,375 % éch. 15/06/2026		16		14	0,28
HSBC Holdings PLC					
5,750 % éch. 20/12/2027	£	16		19	0,39
Hudson Pacific Properties LP					
5,950 % éch. 15/02/2028	$	10		9	0,18
JPMorgan Chase & Co.					
2,947 % éch. 24/02/2028		52		47	0,95
Manulife Financial Corp.					
3,703 % éch. 16/03/2032		26		23	0,47
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.					
3,741 % éch. 07/03/2029		50		46	0,93
Mizuho Financial Group, Inc.					
0,214 % éch. 07/10/2025	€	100		98	1,99
3,490 % éch. 05/09/2027		100		104	2,11
NatWest Group PLC					
4,067 % éch. 06/09/2028		100		104	2,11
NTT Finance Corp.					
0,082 % éch. 13/12/2025	€	100	$	97	1,97
OneMain Finance Corp.					
5,625 % éch. 15/03/2023	$	16		16	0,33
6,125 % éch. 15/03/2024		16		16	0,32
Pacific Life Global Funding					
1,375 % éch. 14/04/2026		19		17	0,35
Radian Group, Inc.					
6,625 % éch. 15/03/2025		12		12	0,24
Santander Holdings USA, Inc.					
5,807 % éch. 09/09/2026		30		30	0,61
SBA Communications Corp.					
3,875 % éch. 15/02/2027		18		16	0,32
Wells Fargo & Co.					
4,540 % éch. 15/08/2026		50		49	0,99
Weyerhaeuser Co.					
3,375 % éch. 09/03/2033		36		30	0,61
				1 178	23,90
INDUSTRIE					
Ball Corp.					
2,875 % éch. 15/08/2030		16		13	0,26
Elevance Health, Inc.					
2,550 % éch. 15/03/2031		28		24	0,49
FactSet Research Systems, Inc.					
3,450 % éch. 01/03/2032		18		15	0,30
Ford Motor Co.					
6,100 % éch. 19/08/2032		10		9	0,18
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide					
1,875 % éch. 31/03/2028	€	27		25	0,51
HCA, Inc.					
3,625 % éch. 15/03/2032	$	28		24	0,49
Hilton Domestic Operating Co., Inc.					
3,625 % éch. 15/02/2032		20		16	0,32
3,750 % éch. 01/05/2029		18		16	0,32
MSCI, Inc.					
3,625 % éch. 01/09/2030		22		18	0,37
Nucor Corp.					
4,300 % éch. 23/05/2027		10		10	0,20
S&P Global, Inc.					
4,750 % éch. 01/08/2028		48		48	0,97
VeriSign, Inc.					
2,700 % éch. 15/06/2031		30		24	0,49
VMware, Inc.					
3,900 % éch. 21/08/2027		18		17	0,35
Walt Disney Co.					
2,200 % éch. 13/01/2028		52		46	0,93
Warnermedia Holdings, Inc.					
4,054 % éch. 15/03/2029		28		24	0,49
Western Digital Corp.					
4,750 % éch. 15/02/2026		16		15	0,30
Xylem, Inc.					
1,950 % éch. 30/01/2028		30		26	0,53
				370	7,50
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS					
Clearway Energy Operating LLC					
3,750 % éch. 15/02/2031	$	14	$	12	0,24
Duke Energy Florida LLC					
2,500 % éch. 01/12/2029		54		46	0,93
Lumen Technologies, Inc.					
4,000 % éch. 15/02/2027		18		15	0,31
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.					
1,900 % éch. 15/06/2028		54		46	0,93
Verizon Communications, Inc.					
1,500 % éch. 18/09/2030		25		20	0,41
Vodafone Group PLC					
5,125 % éch. 04/06/2081		18		13	0,26
				152	3,08
Total des Obligations et billets privés				1 700	34,48
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN					
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA					
3,000 % éch. 01/02/2053		80		70	1,43
3,500 % éch. 01/02/2053		220		200	4,06
				270	5,49
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS					
St. Paul's CLO DAC					
2,128 % éch. 15/01/2032	€	100		105	2,12
INSTRUMENTS À COURT TERME					
BONS DU TRÉSOR AUTRICHIEN					
Bons du Trésor autrichien					
1,267 % éch. 23/02/2023 (a)(b)		100		106	2,16
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS					
(0,198) % éch. 27/03/2023 (a)(b)	¥	41 000		311	6,31
(0,179) % éch. 27/03/2023 (a)(b)		29 000		220	4,46
				531	10,77
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN					
4,245 % éch. 02/03/2023 (a)(b)	$	800		795	16,13
4,290 % éch. 09/03/2023 (a)(b)		1 400		1 389	28,19
4,397 % éch. 23/03/2023 (a)(b)		100		99	2,01
				2 283	46,33
Total des Instruments à court terme				2 920	59,26
Total des Valeurs mobilières			**$**	**5 070**	**102,88**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Long	03/2023	1	$ (4)	(0,09)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Long	03/2023	2	(2)	(0,04)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	11	(8)	(0,16)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Court	03/2023	3	5	0,11
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	2	0	0,00
				$ (9)	(0,18)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ (9)**	**(0,18)**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000 %	15/03/2033	£ 120	$ 3	0,06
À recevoir	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250	15/03/2028	100	3	0,07
À payer	Bon bancaire en CAD à 3 mois	2,060	28/10/2023	CAD 600	(4)	(0,10)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	€ 100	(1)	(0,01)
					$ 1	0,02
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ 1**	**0,02**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	02/2023	CAD 10	$ 8	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	02/2023	€ 3	3	0	0	0	0,00
	02/2023	£ 8	10	0	0	0	0,00
	02/2023	$ 3	€ 3	0	0	0	0,00
	02/2023	48	¥ 6 600	4	0	4	0,05
BRC	02/2023	€ 100	$ 98	0	(8)	(8)	(0,17)
	02/2023	$ 3	€ 3	0	0	0	0,00
CBK	02/2023	€ 3	$ 3	0	0	0	0,00
	02/2023	$ 14	AUD 20	0	0	0	0,01
	03/2023	¥ 32 400	$ 239	0	(9)	(9)	(0,19)
MYI	03/2023	37 600	277	0	(11)	(11)	(0,21)
SCX	02/2023	€ 623	649	0	(19)	(19)	(0,36)
				$ 4	$ (47)	$ (43)	(0,87)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et Institutions en EUR (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
CBK	01/2023	€ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$ 83	€ 80	2	0	2	0,04
GLM	01/2023	81	78	2	0	2	0,04
MYI	01/2023	€ 2	$ 2	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	$ 81	€ 78	2	0	2	0,04
				$ 6	$ 0	$ 6	0,12

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 81	£ 67	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BRC	01/2023	2	1	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	82	67	0	(1)	(1)	(0,01)
SCX	01/2023	81	67	1	0	1	0,01
				$ 1	$ (1)	$ 0	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ (37)**	**(0,75)**
Total des Investissements	**$ 5 025**	**101,97**
Autres actifs et passifs à court terme	**$ (97)**	**(1,97)**
Actif net	**$ 4 928**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* **Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(c) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : S/O) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Citigroup, Inc.	4,615 %	25/01/2026	27/07/2022	$ 49	$ 49	0,99

Un montant en numéraire de 31 $ a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 5 070	$ 0	$ 5 070
Instruments financiers dérivés[3]	(4)	(41)	0	(45)
Totaux	**$ (4)**	**$ 5 029**	**$ 0**	**$ 5 025**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ 4	$ 0	$ 4
BRC	(8)	0	(8)
CBK	(8)	0	(8)
GLM	2	0	2
MYI	(11)	0	(11)
SCX	(16)	0	(16)

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)[1]
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	32,23	S/O
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	70,65	S/O
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,18)	S/O
Instruments financiers dérivés compensés	0,02	S/O
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,75)	S/O

(1) Le Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund a été lancé le 27 juillet 2022.

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ACTIONS ORDINAIRES			
Enbridge, Inc.	92 200	$ 3 601	3,00
Pembina Pipeline Corp.	128 600	4 362	3,63
TC Energy Corp.	73 720	2 937	2,44
Total Canada		10 900	9,07
ÉTATS-UNIS			
ACTIONS ORDINAIRES			
ÉNERGIE			
Antero Resources Corp. (a)	26 400	818	0,68
Cheniere Energy, Inc.	36 133	5 418	4,51
Chesapeake Energy Corp.	53 400	5 039	4,19
ConocoPhillips	19 000	2 242	1,87
Devon Energy Corp.	30 200	1 858	1,55
Diamondback Energy, Inc.	7 800	1 067	0,89
DTE Midstream LLC	84 900	4 692	3,90
EnLink Midstream LLC	292 900	3 603	3,00
EOG Resources, Inc.	8 700	$ 1 127	0,94
EQT Corp.	74 800	2 530	2,11
Equitrans Midstream Corp.	492 882	3 302	2,75
Marathon Oil Corp.	58 500	1 584	1,32
Occidental Petroleum Corp.	26 066	1 642	1,37
ONEOK, Inc.	54 130	3 556	2,96
Pioneer Natural Resources Co.	17 400	3 974	3,31
Targa Resources Corp.	77 400	5 689	4,73
Williams Cos., Inc.	180 200	5 929	4,92
Total États-Unis		54 070	45,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BILLETS À COURT TERME			
Federal Home Loan Bank 4,035 % éch. 27/01/2023 (b)(c)	$ 1 900	1 894	1,57
4,345 % éch. 06/03/2023	3 000	3 000	2,50
		4 894	4,07
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
4,034 % éch. 26/01/2023 (b)(c)	35 500	$ 35 412	29,48
4,449 % éch. 30/03/2023 (b)(c)	1 700	1 683	1,40
		37 095	30,88
Total des Instruments à court terme		41 989	34,95
Total des Valeurs mobilières		**$ 106 959**	**89,02**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)	1 188 741	11 833	9,85
Total des Fonds d'investissement		**$ 11 833**	**9,85**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
SSB	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 811	Billets du Trésor américain 1,875 % échéance 30/06/2026	$ (827)	$ 811	$ 811	0,68
Total des Contrats de mise en pension						**$ (827)**	**$ 811**	**$ 811**	**0,68**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

Contrepartie	À payer/à recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel	Date d'échéance	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
FAR	À recevoir	Indice Alerian MLP Index	3 002	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	$ 4 475	12/04/2023	$ 0	$ (17)	$ (17)	(0,01)

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR TITRES

Contrepartie	À payer/à recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel	Date d'échéance	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	À recevoir	Energy Transfer LP	280 669	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	$ 3 332	18/01/2023	$ 0	$ (14)	$ (14)	(0,01)
	À recevoir	Enterprise Products Partners LP	269 570	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	6 502	18/01/2023	0	(26)	(26)	(0,02)
	À recevoir	Western Midstream Partners LP	130 861	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	3 514	18/01/2023	0	(14)	(14)	(0,01)
	À recevoir	Energy Transfer LP	296 220	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	3 513	12/04/2023	0	(12)	(12)	(0,01)
	À recevoir	Genesis Energy LP	189 800	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	1 938	15/11/2023	0	(8)	(8)	(0,01)
	À recevoir	MPLX LP	230 900	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	7 583	15/11/2023	0	(29)	(29)	(0,02)
	À recevoir	Plains All American Pipeline LP	301 256	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	3 543	15/11/2023	0	(14)	(14)	(0,01)
	À recevoir	Sunoco LP	83 100	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	3 582	15/11/2023	0	(13)	(13)	(0,01)
CBK	À recevoir	Energy Transfer LP	177 084	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	2 102	12/04/2023	0	(8)	(8)	(0,01)
FAR	À recevoir	Crestwood Equity Partners LP	56 900	LIBOR USD à 1 mois moins un écart donné	1 490	06/09/2023	0	1	1	0,00
	À recevoir	Crestwood Equity Partners LP	15 800	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	414	06/09/2023	0	(2)	(2)	0,00
JPM	À recevoir	Crestwood Equity Partners LP	13 000	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	340	06/09/2023	0	(1)	(1)	0,00
MYI	À recevoir	Plains All American Pipeline LP	426 400	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	5 014	18/01/2023	0	(21)	(21)	(0,02)

Tableau des investissements Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (suite)

Contrepartie	À payer/à recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel	Date d'échéance	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
	À recevoir	Enterprise Products Partners LP	34 800	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	$ 843	12/04/2023	$ 0	$ (7)	$ (7)	(0,01)
	À recevoir	Western Midstream Partners LP	94 489	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	2 475	12/04/2023	0	51	51	0,05
	À recevoir	Western Gas Partners LP	68 832	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	1 848	15/11/2023	0	(7)	(7)	(0,01)
							$ 0	$ (124)	$ (124)	(0,10)

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
MYI	01/2023	$ 771	€ 723	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
SCX	01/2023	CAD 4 268	$ 3 177	27	0	27	0,02
TOR	01/2023	10 849	8 070	63	0	63	0,06
				$ 91	$ 0	$ 91	0,08

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et Institutions en EUR (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 12	€ 11	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BPS	01/2023	17	16	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	€ 1 974	$ 2 092	0	(16)	(16)	(0,01)
	01/2023	$ 17 490	€ 16 860	512	0	512	0,42
JPM	01/2023	789	759	21	0	21	0,02
MBC	01/2023	€ 2 477	$ 2 620	0	(25)	(25)	(0,02)
	01/2023	$ 17 453	€ 16 651	326	0	326	0,27
SCX	01/2023	17 007	16 340	439	0	439	0,36
				$ 1 298	$ (41)	$ 1 257	1,04

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 45	$ 55	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	01/2023	$ 32	£ 26	0	0	0	0,00
JPM	01/2023	629	521	0	(2)	(2)	0,00
MBC	01/2023	£ 45	$ 55	1	0	1	0,00
	01/2023	$ 613	£ 512	3	0	3	0,00
MYI	01/2023	£ 39	$ 48	1	0	1	0,00
	01/2023	$ 21	£ 17	0	(1)	(1)	0,00
TOR	01/2023	616	512	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	£ 17	$ 21	0	0	0	0,00
				$ 6	$ (3)	$ 3	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ 1 210**	**1,01**
Total des Investissements	**$ 120 813**	**100,56**
Autres actifs et passifs à court terme	**$ (676)**	**(0,56)**
Actif net	**$ 120 137**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* **Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

(a) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Affilié au Fonds.

Un montant en numéraire de 2 870 $ (31 décembre 2021 : 0 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 64 970	$ 41 989	$ 0	$ 106 959
Fonds d'investissement	11 833	0	0	11 833
Contrats de mise en pension	0	811	0	811
Instruments financiers dérivés[3]	0	1 210	0	1 210
Totaux	**$ 76 803**	**$ 44 010**	**$ 0**	**$ 120 813**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 45 541	$ 45 693	$ 0	$ 91 234
Fonds d'investissement	9 531	0	0	9 531
Instruments financiers dérivés[3]	0	395	0	395
Totaux	**$ 55 072**	**$ 46 088**	**$ 0**	**$ 101 160**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ (129)	$ 1 610	$ 1 481	$ (2)	$ (400)	$ (402)
BPS	S/O	S/O	S/O	21	0	21
CBK	488	(370)	118	300	(330)	(30)
FAR	(18)	550	532	(4)	0	(4)
GLM	S/O	S/O	S/O	(1)	0	(1)
JPM	18	0	18	1	0	1
MBC	305	(310)	(5)	S/O	S/O	S/O
MYI	17	710	727	11	(610)	(599)
RBC	S/O	S/O	S/O	68	0	68
SCX	466	(270)	196	85	0	85
TOR	63	0	63	(93)	0	(93)
UAG	S/O	S/O	S/O	9	0	9

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	54,07	49,88
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	34,95	40,87
Fonds d'investissement	9,85	9,48
Contrats de mise en pension	0,68	S/O
Instruments financiers dérivés hors cote	1,01	0,39

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Canada	9,07	9,60
États-Unis	45,00	35,70
Instruments à court terme	34,95	45,45
Fonds d'investissement	9,85	9,48
Contrats de mise en pension	0,68	S/O
Instruments financiers dérivés hors cote		
Swaps de rendement total sur indices	(0,01)	0,02
Swaps de rendement total sur titres	(0,10)	0,29
Contrats de change à terme	0,08	(0,16)
Contrats de change à terme couverts	1,04	0,24
Autres actifs et passifs à court terme	(0,56)	(0,62)
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds Mortgage Opportunities Fund

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
BANQUE ET FINANCE			
SLM Student Loan Trust			
2,596 % éch. 15/12/2033	€ 694	$ 707	0,09
INDUSTRIE			
Times Square Hotel Trust			
8,528 % éch. 01/08/2026	$ 105	104	0,01
Total des Obligations et billets privés		811	0,10
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Fannie Mae			
0,000 % éch. 25/05/2033 - 25/05/2048 (b)(c)	6 083	4 568	0,54
0,000 % éch. 25/11/2042 - 25/05/2051	4 424	2 480	0,29
0,000 % éch. 25/06/2043 - 25/03/2060 (a)	314 549	5 803	0,68
0,009 % éch. 25/10/2042	11	7	0,00
0,062 % éch. 25/02/2062 (a)	10 116	765	0,09
0,200 % éch. 25/02/2043 (a)	2 513	18	0,00
0,217 % éch. 25/09/2042	952	531	0,06
0,434 % éch. 25/03/2033	762	571	0,07
0,456 % éch. 25/12/2042	1 238	795	0,09
0,516 % éch. 25/03/2033	115	88	0,01
0,611 % éch. 25/06/2050 (a)	3 108	275	0,03
0,665 % éch. 25/10/2043	118	84	0,01
0,880 % éch. 25/03/2047	53	39	0,00
1,561 % éch. 25/04/2044 (a)	1 597	157	0,02
1,611 % éch. 25/05/2046 - 25/01/2050 (a)	21 071	2 461	0,29
1,661 % éch. 25/10/2042 - 25/07/2059 (a)	41 815	4 434	0,52
1,711 % éch. 25/06/2037 - 25/07/2050 (a)	27 976	3 000	0,35
1,761 % éch. 25/12/2042 - 25/09/2048 (a)	11 001	1 292	0,15
1,811 % éch. 25/11/2047 - 25/06/2048 (a)	30 174	3 452	0,41
1,861 % éch. 25/04/2043 (a)	2 054	133	0,02
1,911 % éch. 25/05/2030 (a)	1 670	75	0,01
1,973 % éch. 25/08/2033	279	244	0,03
2,000 % éch. 25/10/2050 (a)	3 089	362	0,04
2,040 % éch. 25/08/2033	84	73	0,01
2,141 % éch. 25/01/2041 (a)	579	66	0,01
2,211 % éch. 25/09/2040 - 25/09/2042 (a)	3 647	283	0,03
2,261 % éch. 25/05/2034 (a)	456	7	0,00
2,411 % éch. 25/12/2032 (a)	535	48	0,01
2,500 % éch. 25/12/2027 - 25/09/2051 (a)	65 500	9 150	1,08
2,711 % éch. 25/11/2033 - 25/10/2034 (a)	814	48	0,01
2,811 % éch. 25/10/2042 (a)	469	61	0,01
3,000 % éch. 25/11/2027 - 25/01/2051 (a)	55 685	8 346	0,98
3,000 % éch. 01/02/2057 - 01/07/2060 (h)	25 033	22 008	2,59
3,211 % éch. 25/11/2033 (a)	50	4	0,00
3,500 % éch. 25/02/2028 - 25/11/2047 (a)	24 403	3 881	0,46
3,508 % éch. 01/08/2049 (h)	611	602	0,07
3,510 % éch. 01/03/2029 (h)	1 116	1 062	0,13
3,652 % éch. 01/12/2048 (h)	597	596	0,07
3,700 % éch. 25/07/2023	25	24	0,00
3,870 % éch. 01/07/2027 (h)	1 600	1 527	0,18
4,000 % éch. 25/04/2032 - 25/07/2050 (a)	32 355	5 660	0,67
4,000 % éch. 25/05/2050	1 960	1 738	0,21
4,500 % éch. 25/06/2029 - 25/07/2050 (a)	6 364	946	0,11
4,500 % éch. 01/04/2059 (h)	4 639	4 525	0,53
5,000 % éch. 25/04/2034 - 25/06/2050 (a)	1 783	351	0,04
5,199 % éch. 25/01/2041	223	183	0,02
5,500 % éch. 25/06/2035 - 25/02/2040 (a)	2 193	457	0,05
5,620 % éch. 01/06/2041 (h)	474	484	0,06
6,000 % éch. 25/04/2032 - 25/03/2033 (a)	325	52	0,01
6,500 % éch. 25/12/2034 (a)	$ 1 464	$ 238	0,03
6,599 % éch. 25/04/2042	86	68	0,01
Freddie Mac			
0,000 % éch. 15/10/2032 - 15/06/2044	5 538	3 943	0,46
0,000 % éch. 01/02/2035 - 15/08/2057 (b)(c)	7 758	6 032	0,71
0,000 % éch. 15/01/2038 - 15/04/2047 (a)	16 050	792	0,09
0,032 % éch. 15/08/2047 (a)	3 872	195	0,02
0,144 % éch. 15/07/2043	11	8	0,00
0,182 % éch. 15/08/2040 (a)	1 798	52	0,01
0,217 % éch. 15/09/2042	915	528	0,06
0,387 % éch. 25/08/2024 (a)	56 210	350	0,04
0,416 % éch. 15/05/2041	1 425	1 195	0,14
0,443 % éch. 15/11/2048 (a)	43 552	1 347	0,16
0,464 % éch. 15/05/2041	361	287	0,03
0,547 % éch. 15/10/2042	483	320	0,04
0,682 % éch. 15/04/2042 (a)	1 611	80	0,01
0,800 % éch. 15/12/2048	379	370	0,04
1,013 % éch. 15/01/2043	1 652	1 157	0,14
1,532 % éch. 15/02/2041 (a)	291	23	0,00
1,572 % éch. 15/09/2043 (a)	795	73	0,01
1,632 % éch. 15/07/2041 - 15/12/2041 (a)	2 645	207	0,02
1,661 % éch. 25/11/2049 - 25/06/2050 (a)	27 584	2 880	0,34
1,682 % éch. 15/10/2041 - 15/08/2042 (a)	11 360	1 241	0,15
1,711 % éch. 25/06/2050 (a)	11 599	1 364	0,16
1,732 % éch. 15/08/2041 - 15/09/2044 (a)	7 997	781	0,09
1,761 % éch. 25/05/2050 (a)	8 624	1 131	0,13
1,782 % éch. 15/02/2044 (a)	167	25	0,00
1,832 % éch. 15/08/2025 - 15/10/2048 (a)	13 095	1 549	0,18
1,882 % éch. 15/03/2048 (a)	3 381	417	0,05
1,932 % éch. 15/09/2042 (a)	997	74	0,01
1,982 % éch. 15/10/2036 (a)	1 176	83	0,01
2,000 % éch. 25/11/2050 - 25/01/2051 (a)	6 291	582	0,07
2,152 % éch. 15/11/2037 (a)	243	18	0,00
2,172 % éch. 15/01/2042 (a)	6 111	713	0,08
2,282 % éch. 15/07/2023 - 15/11/2041 (a)	164	8	0,00
2,332 % éch. 15/07/2026 (a)	723	17	0,00
2,382 % éch. 15/09/2026 - 15/12/2042 (a)	2 108	266	0,03
2,412 % éch. 15/09/2039 (a)	2 723	263	0,03
2,500 % éch. 15/11/2027 - 25/11/2051 (a)	45 577	5 771	0,68
2,532 % éch. 15/03/2038 (a)	485	40	0,00
2,532 % éch. 15/08/2043	250	175	0,02
2,920 % éch. 01/09/2036 (h)	1 520	1 206	0,14
3,000 % éch. 15/03/2027 - 25/06/2051 (a)	97 706	14 689	1,73
3,314 % éch. 15/12/2027 (a)	641	33	0,00
3,439 % éch. 25/09/2024	6 100	5 379	0,63
3,500 % éch. 15/03/2029 - 25/03/2052 (a)	30 578	4 994	0,59
3,500 % éch. 01/01/2038 - 01/12/2046 (h)	1 027	967	0,11
3,582 % éch. 15/12/2031 (a)	56	6	0,00
4,000 % éch. 15/10/2041 - 25/08/2050 (a)	25 830	5 725	0,67
4,000 % éch. 01/03/2046 - 01/04/2048 (h)	10 907	10 463	1,23
4,108 % éch. 15/09/2032	294	276	0,03
4,459 % éch. 25/12/2036	7 296	5 840	0,69
4,500 % éch. 15/02/2037 - 25/10/2051 (a)	11 077	1 812	0,21
4,500 % éch. 01/02/2048 (h)	541	527	0,06
5,000 % éch. 15/05/2025 - 25/05/2048 (a)	1 883	322	0,04
5,000 % éch. 01/03/2049 (h)	2 823	2 848	0,34
5,728 % éch. 25/01/2051	2 503	2 445	0,29
Ginnie Mae			
0,000 % éch. 20/08/2033 - 20/01/2044 (b)(c)	2 256	2 020	0,24
0,000 % éch. 20/05/2040 - 20/08/2047 (a)	62 503	1 970	0,23
0,000 % éch. 20/11/2045	534	337	0,04
1,197 % éch. 20/09/2043 (a)	1 136	33	0,00
1,367 % éch. 20/09/2045 (a)	$ 2 090	$ 151	0,02
1,724 % éch. 16/04/2040 - 16/08/2042 (a)	3 113	241	0,03
1,747 % éch. 20/01/2035 - 20/08/2049 (a)	9 971	667	0,08
1,847 % éch. 20/03/2035 - 20/09/2048 (a)	2 123	244	0,03
1,897 % éch. 20/07/2044 (a)	2 278	338	0,04
2,000 % éch. 16/05/2041	2 612	2 279	0,27
2,074 % éch. 16/01/2038 (a)	26	0	0,00
2,124 % éch. 16/02/2040 (a)	1 788	119	0,01
2,347 % éch. 20/05/2041 (a)	1 494	93	0,01
2,500 % éch. 20/09/2027 (a)	3 796	167	0,02
3,000 % éch. 20/12/2047 - 20/02/2048 (h)	5 351	4 825	0,57
3,000 % éch. 20/12/2049 - 20/02/2052 (a)	13 573	1 608	0,19
3,000 % éch. 20/08/2051	1 773	1 180	0,14
3,250 % éch. 20/01/2047 (h)	450	397	0,05
3,500 % éch. 20/09/2029 - 20/09/2046 (a)	1 445	220	0,03
3,500 % éch. 20/03/2042 - 20/02/2052 (h)	16 682	15 453	1,82
3,500 % éch. 20/01/2052	1 836	1 537	0,18
4,000 % éch. 15/04/2047 - 15/08/2048 (h)	2 532	2 422	0,29
4,500 % éch. 20/05/2043 - 20/09/2047 (a)	2 809	583	0,07
4,500 % éch. 20/04/2048 - 20/02/2049 (h)	2 136	2 077	0,24
4,576 % éch. 20/10/2072	3 954	3 947	0,47
4,971 % éch. 20/03/2058 (h)	182	182	0,02
5,000 % éch. 20/09/2040 (a)	495	0	0,00
5,000 % éch. 20/11/2048 (h)	971	970	0,11
6,000 % éch. 20/02/2047 (h)	16	17	0,00
Ginnie Mae, TBA			
3,000 % éch. 01/01/2053	7 600	6 769	0,80
3,500 % éch. 01/01/2053	10 050	9 240	1,09
4,500 % éch. 01/01/2053	3 620	3 512	0,41
5,000 % éch. 01/01/2053	51 000	50 543	5,95
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)			
2,500 % éch. 01/01/2033 - 01/09/2051 (h)	18 908	16 229	1,91
3,000 % éch. 01/01/2038 - 01/07/2052 (h)	147 224	131 246	15,46
3,000 % éch. 01/12/2049	5	5	0,00
3,500 % éch. 01/02/2030 - 01/06/2051 (h)	44 384	41 503	4,89
3,500 % éch. 01/06/2052	2 289	2 083	0,25
4,000 % éch. 01/02/2037 - 01/08/2049 (h)	26 168	25 124	2,96
4,000 % éch. 01/09/2042 - 01/12/2052	99 611	93 532	11,02
4,500 % éch. 01/12/2038 - 01/01/2049 (h)	3 301	3 293	0,39
4,500 % éch. 01/12/2044	7	7	0,00
5,000 % éch. 01/06/2048 - 01/03/2049 (h)	862	864	0,10
5,000 % éch. 01/01/2053	100 000	98 711	11,63
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
2,500 % éch. 01/01/2038 - 01/01/2053	12 000	10 852	1,28
3,000 % éch. 01/01/2053	7 500	6 584	0,78
3,500 % éch. 01/01/2038 - 01/02/2053	40 400	37 468	4,41
4,500 % éch. 01/01/2038 - 01/02/2053	120 800	117 140	13,80
5,500 % éch. 01/02/2053	2 700	2 706	0,32
6,000 % éch. 01/01/2053	105 200	106 726	12,57
6,500 % éch. 01/01/2053	36 700	37 584	4,43
		1 031 809	121,51

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN					
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (e)					
0,125 % éch. 15/10/2024	$	465	$	447	0,05
0,500 % éch. 15/04/2024		1 004		977	0,12
0,625 % éch. 15/01/2024		2 963		2 900	0,34
				4 324	0,51
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX					
1166 Avenue of the Americas Commercial Mortgage Trust					
5,690 % éch. 13/10/2037		2 000		1 646	0,19
225 Liberty Street Trust					
4,649 % éch. 10/02/2036		5 000		4 302	0,51
American Home Mortgage Assets Trust					
4,514 % éch. 25/03/2047		2 206		1 925	0,23
American Home Mortgage Investment Trust					
4,969 % éch. 25/11/2045		2 020		1 745	0,21
5,883 % éch. 25/09/2035		594		328	0,04
6,500 % éch. 25/03/2047		1 203		896	0,11
Angel Oak Mortgage Trust					
1,469 % éch. 25/06/2065 (h)		555		497	0,06
2,336 % éch. 25/04/2066		3 638		2 005	0,24
Ashford Hospitality Trust					
6,418 % éch. 15/04/2035		12 000		11 068	1,30
7,068 % éch. 15/06/2035		6 900		6 524	0,77
Atlas Funding PLC					
4,694 % éch. 25/07/2058	£	1 150		1 347	0,16
5,244 % éch. 25/07/2058		950		1 112	0,13
Banc of America Funding Trust					
4,599 % éch. 26/05/2037	$	3 784		3 243	0,38
5,763 % éch. 25/10/2036		1 786		1 565	0,18
Barley Hill PLC					
4,832 % éch. 27/08/2058	£	4 900		5 634	0,66
5,132 % éch. 27/08/2058		2 953		3 364	0,40
BCAP LLC Trust					
4,669 % éch. 25/04/2037	$	1 639		1 472	0,17
Bear Stearns ALT-A Trust					
5,514 % éch. 25/01/2035		1 531		1 401	0,17
Bear Stearns Mortgage Funding Trust					
4,569 % éch. 25/06/2037		3 049		2 676	0,32
Braemar Hotels & Resorts Trust					
5,368 % éch. 15/06/2035		2 500		2 381	0,28
Cascade Funding Mortgage Trust					
4,000 % éch. 25/10/2068		982		949	0,11
Chase Mortgage Finance Trust					
3,393 % éch. 25/03/2037 ^		51		47	0,01
ChaseFlex Trust					
5,069 % éch. 25/05/2037		1 713		1 656	0,20
Chester B1 Issuer PLC					
4,185 % éch. 17/01/2058	£	6 388		7 672	0,90
4,485 % éch. 17/01/2058		500		599	0,07
Citigroup Mortgage Loan Trust					
6,000 % éch. 25/12/2035	$	1 361		1 278	0,15
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.					
4,194 % éch. 25/08/2035		13		13	0,00
CitiMortgage Alternative Loan Trust					
4,939 % éch. 25/01/2037		1 553		1 287	0,15
6,000 % éch. 25/11/2036		920		789	0,09
Countrywide Alternative Loan Trust					
2,988 % éch. 25/06/2046		2 179		1 737	0,20
3,048 % éch. 25/12/2035		1 290		1 124	0,13
3,428 % éch. 25/11/2047 ^		3 101		2 502	0,29
4,709 % éch. 25/02/2047		302		257	0,03
4,709 % éch. 25/09/2047		8		7	0,00
4,773 % éch. 20/03/2046		523		408	0,05
4,773 % éch. 20/05/2046 ^		1 889		1 560	0,18
4,949 % éch. 25/10/2046		2 350		2 071	0,24
5,029 % éch. 25/11/2035		4 177		3 313	0,39
5,089 % éch. 25/09/2035		1 873		1 655	0,20
5,500 % éch. 25/06/2035		148		121	0,01
5,500 % éch. 25/07/2035		2 145		1 538	0,18
5,500 % éch. 25/10/2035		1 198		863	0,10
5,500 % éch. 25/11/2035 ^		1 728		1 015	0,12
5,500 % éch. 25/12/2035		246		175	0,02
6,000 % éch. 25/05/2036		3 552		2 138	0,25
6,000 % éch. 25/02/2037 ^		1 426		603	0,07
6,250 % éch. 25/05/2036		281		167	0,02
6,250 % éch. 25/09/2037	$	511	$	348	0,04
Countrywide Asset-Backed Certificates					
4,889 % éch. 25/03/2036		560		557	0,07
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust					
2,980 % éch. 25/04/2035 ^		233		170	0,02
3,302 % éch. 20/04/2036		44		39	0,00
3,548 % éch. 20/04/2036		568		461	0,05
3,632 % éch. 20/11/2035		3 388		2 993	0,35
5,750 % éch. 25/07/2037 ^		739		374	0,04
6,500 % éch. 25/11/2037 ^		2 231		859	0,10
6,500 % éch. 25/12/2037		5 242		2 431	0,29
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust					
5,500 % éch. 25/10/2021		15		13	0,00
DBGS Mortgage Trust					
5,818 % éch. 15/06/2033		2 422		2 150	0,25
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust					
4,869 % éch. 25/01/2047		5 171		4 279	0,50
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust					
4,529 % éch. 19/10/2036		4 679		3 755	0,44
Eurosail PLC					
2,245 % éch. 13/03/2045	€	550		566	0,07
2,440 % éch. 10/09/2044		800		791	0,09
4,061 % éch. 13/06/2045	£	1 673		1 548	0,18
4,511 % éch. 13/06/2045		332		353	0,04
Fingal Securities RMBS DAC					
3,078 % éch. 28/07/2055 (h)	€	8 200		8 725	1,03
3,578 % éch. 28/07/2055 (h)		21 845		23 269	2,74
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust					
4,797 % éch. 25/07/2035	$	207		186	0,02
Greenpoint Mortgage Funding Trust					
4,789 % éch. 25/10/2046		5 551		4 895	0,58
Grifonas Finance PLC					
1,264 % éch. 28/08/2039	€	997		967	0,11
GS Mortgage Securities Corp. Trust					
4,579 % éch. 10/10/2032	$	5 821		5 588	0,66
5,768 % éch. 15/07/2031		600		566	0,07
6,018 % éch. 15/07/2031		2 000		1 857	0,22
GS Mortgage Securities Trust					
3,805 % éch. 10/10/2035		3 700		3 120	0,37
GSMPS Mortgage Loan Trust					
4,789 % éch. 25/04/2036		362		300	0,04
7,058 % éch. 20/10/2032		1 289		1 112	0,13
GSMSC Resecuritization Trust					
3,544 % éch. 26/04/2037		7 355		2 125	0,25
HomeBanc Mortgage Trust					
5,199 % éch. 25/10/2035		7 184		6 146	0,72
Hops Hill PLC					
5,282 % éch. 27/05/2054	£	3 000		3 503	0,41
5,782 % éch. 27/05/2054		1 100		1 277	0,15
HSI Asset Securitization Corp. Trust					
5,349 % éch. 25/07/2035	$	1 100		1 065	0,13
IndyMac Mortgage Loan Trust					
3,331 % éch. 25/12/2035 ^		3 167		2 026	0,24
3,530 % éch. 25/12/2035		357		274	0,03
4,789 % éch. 25/10/2036		3 425		2 998	0,35
JPMorgan Alternative Loan Trust					
4,709 % éch. 25/11/2036 ^		4 698		4 086	0,48
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust					
3,756 % éch. 05/01/2031		443		442	0,05
5,350 % éch. 05/07/2033		1 950		1 701	0,20
6,039 % éch. 12/02/2051		65		541	0,06
JPMorgan Resecuritization Trust					
4,512 % éch. 26/04/2037		955		498	0,06
5,319 % éch. 26/09/2037		1 359		1 025	0,12
Lehman Mortgage Trust					
6,000 % éch. 25/12/2036		1 519		1 241	0,15
Lehman XS Trust					
4,869 % éch. 25/06/2047		6 026		5 366	0,63
MASTR Asset Securitization Trust					
6,000 % éch. 25/10/2036		685		598	0,07
MASTR Reperforming Loan Trust					
7,000 % éch. 25/07/2035		1 283		910	0,11
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust					
6,250 % éch. 25/08/2036		4 111		1 884	0,22
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust					
5,500 % éch. 25/11/2035		1 074		732	0,09
6,000 % éch. 25/10/2037	$	6 311	$	3 353	0,40
Mortgage Equity Conversion Asset Trust					
5,130 % éch. 25/02/2042		938		872	0,10
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust					
3,189 % éch. 25/10/2035		1 052		642	0,08
6,017 % éch. 25/06/2037		1 287		1 060	0,13
Nomura Resecuritization Trust					
0,299 % éch. 26/11/2036		2 088		1 841	0,22
Residential Accredit Loans, Inc. Trust					
4,689 % éch. 25/08/2036		888		672	0,08
4,756 % éch. 25/12/2035		1 206		580	0,07
6,000 % éch. 25/01/2037 ^		177		135	0,02
6,250 % éch. 25/01/2037 ^		1 045		834	0,10
Residential Asset Securitization Trust					
6,000 % éch. 25/12/2036 ^		2 991		966	0,11
RMAC Securities PLC					
3,676 % éch. 12/06/2044	£	399		440	0,05
Sestante Finance SRL					
1,722 % éch. 23/07/2046	€	920		916	0,11
Stratton BTL Mortgage Funding PLC					
4,576 % éch. 20/01/2054	£	3 000		3 169	0,37
Stratton Mortgage Funding PLC					
4,426 % éch. 20/07/2060		8 100		9 614	1,13
4,842 % éch. 25/09/2051		3 250		3 844	0,45
4,926 % éch. 20/07/2060		2 200		2 602	0,31
5,142 % éch. 25/09/2051		5 000		5 846	0,69
5,426 % éch. 20/07/2060		2 500		2 960	0,35
5,926 % éch. 20/07/2060		3 600		4 225	0,50
6,387 % éch. 12/03/2052		1 400		1 616	0,19
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust					
3,780 % éch. 25/02/2034	$	9		8	0,00
3,828 % éch. 25/07/2035		1 611		822	0,10
3,845 % éch. 25/05/2035		1 006		787	0,09
4,502 % éch. 25/12/2034		1 764		1 618	0,19
4,689 % éch. 25/02/2037		497		465	0,05
4,829 % éch. 25/06/2037		368		313	0,04
Structured Asset Mortgage Investments Trust					
4,609 % éch. 25/09/2047		3 360		2 720	0,32
4,929 % éch. 25/08/2035		504		433	0,05
5,464 % éch. 19/12/2033		433		401	0,05
Structured Asset Securities Corp.					
4,639 % éch. 25/07/2035		1 460		1 348	0,16
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust					
4,639 % éch. 25/05/2036		2 100		1 722	0,20
Trinity Square PLC					
4,279 % éch. 15/07/2059	£	9 600		11 333	1,33
4,579 % éch. 15/07/2059		3 200		3 739	0,44
4,879 % éch. 15/07/2059		2 400		2 767	0,33
5,629 % éch. 15/07/2059		1 600		1 844	0,22
Tudor Rose Mortgages					
4,331 % éch. 20/06/2048		3 705		4 271	0,50
4,581 % éch. 20/06/2048		5 105		5 659	0,67
4,931 % éch. 20/06/2048		9 746		10 746	1,27
Twin Bridges PLC					
5,087 % éch. 01/12/2055		3 007		3 120	0,37
Uropa Securities PLC					
3,166 % éch. 10/10/2040		69		78	0,01
3,266 % éch. 10/10/2040		35		38	0,00
Verus Securitization Trust					
1,977 % éch. 25/03/2060 (h)	$	262		251	0,03
2,338 % éch. 25/10/2063		1 250		994	0,12
3,035 % éch. 25/03/2060		200		185	0,02
3,195 % éch. 25/10/2063		1 000		762	0,09
3,889 % éch. 25/03/2060		400		363	0,04
4,199 % éch. 25/10/2063		1 000		755	0,09
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
2,818 % éch. 25/04/2047 ^		64		54	0,01
3,008 % éch. 25/09/2046		959		778	0,09
3,227 % éch. 25/06/2037 ^		3 215		2 791	0,33
3,298 % éch. 25/01/2047		677		604	0,07
3,510 % éch. 25/12/2036 ^		2 269		1 967	0,23
3,548 % éch. 25/11/2046		307		265	0,03
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust					
3,038 % éch. 25/06/2046		2 091		1 615	0,19
Worldwide Plaza Trust					
3,596 % éch. 10/11/2036		3 950		2 703	0,32
				315 891	37,20

Tableau des investissements Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS			
Accredited Mortgage Loan Trust			
5,259 % éch. 25/09/2035	$ 4 200	$ 3 933	0,46
5,409 % éch. 25/07/2035	2 150	1 983	0,23
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
5,364 % éch. 25/11/2033	734	699	0,08
Aegis Asset-Backed Securities Trust			
5,389 % éch. 25/03/2035 ^	60	56	0,01
Aegis Asset-Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Certificates			
6,219 % éch. 25/12/2034	1 112	986	0,12
Ameriquest Mortgage Securities Trust			
4,959 % éch. 25/04/2036	6 350	5 499	0,65
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
5,484 % éch. 25/09/2034	3 079	2 773	0,33
Argent Mortgage Loan Trust			
4,869 % éch. 25/05/2035	2 552	2 286	0,27
Argent Securities Trust			
4,689 % éch. 25/07/2036	4 991	4 317	0,51
4,769 % éch. 25/03/2036	4 673	4 043	0,48
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
3,199 % éch. 25/03/2036	1 593	1 347	0,16
3,658 % éch. 25/12/2036	4 731	4 124	0,49
5,619 % éch. 25/02/2035	946	898	0,11
Attentus CDO Ltd.			
4,359 % éch. 11/10/2042	10 048	8 842	1,04
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
4,869 % éch. 25/07/2036	544	537	0,06
4,915 % éch. 25/12/2035	1 677	1 408	0,17
4,929 % éch. 25/04/2036	1 814	1 803	0,21
5,439 % éch. 25/08/2037	8 449	7 562	0,89
5,589 % éch. 25/01/2045	64	63	0,01
6,264 % éch. 25/07/2034	166	159	0,02
Capitalsource Real Estate Loan Trust			
4,559 % éch. 20/01/2037	788	736	0,09
4,659 % éch. 20/01/2037	350	304	0,04
4,759 % éch. 20/01/2037	200	145	0,02
Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC			
5,018 % éch. 21/10/2028	£ 11 400	13 530	1,59
5,368 % éch. 21/10/2028	3 200	3 774	0,44
6,318 % éch. 21/10/2028	8 775	10 145	1,19
Castlelake Aircraft Securitization Trust			
4,125 % éch. 15/06/2043	$ 2 237	1 964	0,23
Citigroup Mortgage Loan Trust			
4,549 % éch. 25/12/2036	3 403	1 919	0,23
Conseco Finance Corp.			
6,920 % éch. 01/12/2030	2 483	2 488	0,29
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
4,539 % éch. 25/04/2047 ^	63	63	0,01
4,539 % éch. 25/06/2047 ^	12	12	0,00
4,609 % éch. 25/09/2037 ^	2 232	2 291	0,27
4,609 % éch. 25/09/2047 ^	1 059	1 009	0,12
4,679 % éch. 25/10/2047	10 000	8 736	1,03
5,089 % éch. 25/03/2036 ^	1 984	1 794	0,21
5,364 % éch. 25/01/2036	71	69	0,01
5,633 % éch. 25/06/2035	92	76	0,01
5,859 % éch. 25/10/2046 ^	16	16	0,00
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.			
5,364 % éch. 25/10/2034	78	76	0,01
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC			
2,801 % éch. 25/05/2036	2 165	1 425	0,17
3,207 % éch. 25/03/2034	299	293	0,03
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Mortgage Loan Trust			
3,547 % éch. 25/02/2037	3 059	1 878	0,22
First Franklin Mortgage Loan Trust			
5,049 % éch. 25/01/2036	552	546	0,06
Fremont Home Loan Trust			
4,669 % éch. 25/02/2037	6 227	4 821	0,57
4,869 % éch. 25/08/2036	4 168	1 445	0,17
5,319 % éch. 25/07/2035	4 000	3 349	0,39
Goodgreen Trust			
3,930 % éch. 15/10/2053	3 076	2 834	0,33
GSAA Home Equity Trust			
4,849 % éch. 25/04/2047	3 864	1 966	0,23
5,109 % éch. 25/10/2035	1 949	1 621	0,19
GSAMP Trust			
4,659 % éch. 25/03/2047	$ 723	$ 663	0,08
5,274 % éch. 25/07/2045 ^	6 976	6 443	0,76
Harley Marine Financing LLC			
6,682 % éch. 15/05/2043	1 285	1 179	0,14
Harvest CLO DAC			
1,040 % éch. 15/07/2031	€ 800	771	0,09
1,600 % éch. 15/10/2031	5 000	4 497	0,53
2,433 % éch. 18/11/2029	35	37	0,00
Home Equity Asset Trust			
3,826 % éch. 25/02/2036	$ 1 030	991	0,12
4,549 % éch. 25/08/2036	1 110	1 101	0,13
4,869 % éch. 25/08/2037	736	722	0,08
5,679 % éch. 25/08/2033	342	332	0,04
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust			
4,629 % éch. 25/04/2037	6 907	4 569	0,54
4,869 % éch. 25/08/2036	6 200	5 263	0,62
5,139 % éch. 25/10/2035	1 093	1 061	0,12
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.			
2,808 % éch. 25/10/2035	4 900	4 054	0,48
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
3,893 % éch. 25/11/2036	200	174	0,02
4,509 % éch. 25/12/2036	6 092	3 317	0,39
Jubilee CLO DAC			
2,028 % éch. 15/04/2031	€ 400	407	0,05
2,128 % éch. 12/07/2028	20	21	0,00
Laurelin DAC			
1,800 % éch. 20/10/2031	3 500	3 130	0,37
Lehman XS Trust			
4,809 % éch. 25/06/2046	$ 3 292	2 937	0,35
Long Beach Mortgage Loan Trust			
4,709 % éch. 25/10/2036	22 577	7 219	0,85
4,989 % éch. 25/02/2036	145	119	0,01
5,409 % éch. 25/08/2033	159	158	0,02
Man GLG Euro CLO DAC			
1,680 % éch. 15/12/2031	€ 4 700	4 217	0,50
1,700 % éch. 15/10/2030	5 000	4 608	0,54
MAPS Ltd.			
4,212 % éch. 15/05/2043	$ 2 199	1 966	0,23
MASTR Asset-Backed Securities Trust			
4,959 % éch. 25/01/2036	2 522	2 464	0,29
4,969 % éch. 25/12/2035	231	230	0,03
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust			
4,534 % éch. 25/08/2037	2 467	2 159	0,25
4,989 % éch. 25/12/2036	2 850	2 677	0,32
5,469 % éch. 25/10/2035	795	780	0,09
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
3,549 % éch. 25/01/2035	820	765	0,09
4,529 % éch. 25/10/2036	1 042	500	0,06
4,639 % éch. 25/07/2036	9 933	8 405	0,99
4,689 % éch. 25/07/2036	3 497	1 425	0,17
4,889 % éch. 25/07/2036	3 497	1 436	0,17
4,959 % éch. 25/12/2035	6 879	5 715	0,67
4,989 % éch. 25/12/2035	4 900	4 484	0,53
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust			
4,969 % éch. 25/01/2036	2 002	1 916	0,23
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust			
4,489 % éch. 25/04/2037	144	80	0,01
Morgan Stanley IXIS Real Estate Capital Trust			
4,689 % éch. 25/07/2036	3 604	1 556	0,18
National Collegiate Student Loan Trust			
4,699 % éch. 25/05/2032	2 683	2 566	0,30
Navient Private Education Loan Trust			
2,740 % éch. 15/02/2029	1	1	0,00
NovaStar Mortgage Funding Trust			
5,559 % éch. 25/06/2035	2 000	1 912	0,22
Option One Mortgage Loan Trust			
4,529 % éch. 25/03/2037	5 224	4 671	0,55
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
5,169 % éch. 25/09/2035	7 700	6 429	0,76
5,964 % éch. 25/02/2035	372	357	0,04
6,039 % éch. 25/12/2034	499	502	0,06
Pepper SPARKZ Trust			
4,062 % éch. 17/08/2028	AUD 1 011	684	0,08
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust			
4,884 % éch. 25/07/2036	$ 2 584	2 411	0,28
4,929 % éch. 25/05/2036 ^	$ 412	$ 368	0,04
Pretium Mortgage Credit Partners LLC			
2,240 % éch. 27/09/2060	3 196	2 926	0,34
Renaissance Home Equity Loan Trust			
5,608 % éch. 25/05/2036	6 006	2 804	0,33
5,746 % éch. 25/05/2036	1 367	653	0,08
Residential Asset Mortgage Products Trust			
4,929 % éch. 25/02/2036	200	188	0,02
Residential Asset Securities Corp. Trust			
4,564 % éch. 25/06/2034	776	746	0,09
4,824 % éch. 25/06/2036	1 400	1 321	0,16
5,334 % éch. 25/05/2035	112	111	0,01
5,424 % éch. 25/08/2035	2 131	1 980	0,23
Sapphire Aviation Finance Ltd.			
4,250 % éch. 15/03/2040	6 241	4 850	0,57
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust			
4,509 % éch. 25/09/2036	2 287	1 589	0,19
SoFi Professional Loan Program LLC			
2,650 % éch. 25/09/2040	53	51	0,01
Soundview Home Loan Trust			
4,559 % éch. 25/07/2037	6 045	5 094	0,60
4,559 % éch. 25/08/2037	6 672	5 734	0,67
4,669 % éch. 25/07/2036	2 521	2 390	0,28
5,289 % éch. 25/10/2037	7 032	5 491	0,65
5,379 % éch. 25/06/2035	698	661	0,08
5,689 % éch. 25/10/2037	5 685	4 202	0,49
Structured Asset Investment Loan Trust			
4,989 % éch. 25/04/2036	11 391	6 229	0,73
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust			
4,519 % éch. 25/05/2036	343	331	0,04
4,699 % éch. 25/08/2046	4 270	3 961	0,47
5,514 % éch. 25/04/2035	95	94	0,01
Taberna Preferred Funding Ltd.			
4,218 % éch. 05/07/2035	247	225	0,03
4,872 % éch. 05/05/2038	5 089	4 847	0,57
Terwin Mortgage Trust			
5,334 % éch. 25/06/2036	200	191	0,02
Thunderbolt Aircraft Lease Ltd.			
4,147 % éch. 15/09/2038	7 227	5 491	0,65
TruPS Financials Note Securitization Ltd.			
6,316 % éch. 20/09/2039	2 867	2 724	0,32
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust			
4,809 % éch. 25/03/2037	1 272	1 235	0,15
		303 211	35,71
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
3,609 % éch. 12/01/2023 (c)(d)	6 600	6 594	0,78
3,984 % éch. 07/02/2023 (c)(d)	10 000	9 962	1,17
4,117 % éch. 02/02/2023 (c)(d)	15 800	15 750	1,85
4,397 % éch. 23/03/2023 (c)(d)	26 800	26 551	3,13
4,449 % éch. 30/03/2023 (c)(d)	10 200	10 096	1,19
Total des Instruments à court terme		68 953	8,12
Total des Valeurs mobilières		**$ 1 724 999**	**203,15**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	2 351	23	0,00
Total des Fonds d'investissement		**$ 23**	**0,00**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BPS	4,310 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 13 700	Billets du Trésor américain 0,625 % échéance 15/05/2030	$ (14 004)	$ 13 700	$ 13 700	1,61
FICC	1,900	30/12/2022	03/01/2023	3 618	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 08/06/2023 - 29/06/2023	(3 690)	3 618	3 618	0,43
Total des Contrats de mise en pension						**$ (17 694)**	**$ 17 318**	**$ 17 318**	**2,04**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2024	985	$ 261	0,03
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Long	09/2023	503	15	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Long	09/2024	340	(191)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Long	06/2023	820	(145)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2023	338	200	0,02
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2024	340	174	0,02
Contrats à terme standardisés sur Fonds fédéraux à 30 jours avril	Long	04/2023	54	31	0,00
Contrats à terme standardisés sur Fonds fédéraux à 30 jours juin	Court	06/2023	54	(9)	0,00
Contrats à terme standardisés sur eurodollar à 90 jours mars	Court	03/2023	365	4 253	0,50
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Court	03/2023	573	(40)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Court	03/2023	171	15	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Court	03/2023	174	53	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	27	(8)	0,00
				$ 4 609	0,54
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ 4 609**	**0,54**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir[1]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000 %	15/03/2053	£ 400	$ 5	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2025	$ 185 600	(4 474)	(0,53)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	21/12/2052	18 400	(830)	(0,10)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2024	95 900	119	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2032	73 400	848	0,10
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,250	18/03/2050	€ 2 400	1 016	0,12
À recevoir[1]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	13 900	360	0,04
					$ (2 956)	(0,35)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ (2 956)**	**(0,35)**

(1) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	5,500 %	18/09/2023	88 600	$ 198	$ 91	0,01
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	1,500	08/06/2023	4 800	19	2	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	0,023	29/06/2023	17 445	928	3 819	0,45
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,228	06/02/2023	5 900	63	15	0,00
BPS	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,500	05/02/2024	76 000	509	2 835	0,33
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,513	06/03/2023	6 000	45	96	0,01
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,800	20/12/2023	5 300	107	87	0,01
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,550	20/12/2023	15 800	320	417	0,05
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,800	20/12/2023	5 200	107	85	0,01
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,550	20/12/2023	15 800	319	417	0,05
CBK	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,400	19/05/2027	13 900	79	130	0,02

Tableau des investissements Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite)

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,500 %	09/02/2024	24 700	$ 179	$ 926	0,11
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,500	20/02/2024	61 000	530	2 301	0,27
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,034	28/02/2023	57 500	362	2 535	0,30
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,880	01/03/2023	18 400	114	863	0,10
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,933	01/03/2023	57 500	362	2 640	0,31
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,380	06/04/2023	7 100	150	209	0,03
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,285	14/04/2023	7 000	166	262	0,03
DUB	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,720	06/03/2023	700	8	8	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,500	07/02/2024	77 500	554	2 899	0,34
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,500	28/02/2024	35 500	288	1 348	0,16
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,500	04/03/2024	35 500	259	1 352	0,16
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,120	06/02/2023	700	8	1	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,518	06/02/2023	31 500	273	412	0,05
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,533	06/02/2023	8 900	76	112	0,01
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,513	06/03/2023	6 000	44	97	0,01
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	5,500	18/09/2023	85 600	188	88	0,01
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,400	19/05/2027	20 000	107	188	0,02
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	4,000	26/10/2023	2 200	66	43	0,01
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,123	06/02/2023	6 100	69	10	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,655	12/12/2023	21 200	462	285	0,03
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,405	12/12/2023	21 200	462	637	0,08
JPM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,635	06/03/2023	5 400	42	67	0,01
MYC	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,998	07/03/2023	56 100	406	2 496	0,29
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,348	13/04/2023	7 000	140	228	0,03
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	20/04/2023	6 800	166	294	0,04
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,273	20/04/2023	6 800	151	268	0,03
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	21/04/2023	7 500	220	342	0,04
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,203	06/02/2023	6 800	73	16	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 7 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,515	06/02/2023	8 100	69	107	0,01
							$ 8 688	$ 29 028	3,42

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
JPM	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 2,000 % échéance 01/01/2053	$ 117,000	05/01/2023	147 000	$ 6	$ 0	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 2,000 % échéance 01/02/2053	100,000	06/02/2023	20 000	1	0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/02/2053	75,000	06/02/2023	70 000	2	0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/02/2053	65,000	06/02/2023	25 500	1	0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	77,000	06/03/2023	70 000	3	1	0,00
					$ 13	$ 1	0,00

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	5,750 %	18/09/2023	44 300	$ (78)	$ (31)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	6,000	18/09/2023	44 300	(66)	(21)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	0,021	29/06/2023	85 485	(928)	(6 704)	(0,79)
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,534	28/02/2023	57 500	(334)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,380	01/03/2023	18 400	(106)	0	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,433	01/03/2023	57 500	(336)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	06/04/2023	39 600	(150)	(477)	(0,06)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	14/04/2023	38 900	(167)	(465)	(0,06)
GLM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	5,750	18/09/2023	42 800	(75)	(30)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	6,000	18/09/2023	42 800	(62)	(20)	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	1,498	07/03/2023	56 100	(381)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	13/04/2023	38 900	(140)	(465)	(0,05)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,000	20/04/2023	75 200	(316)	(645)	(0,08)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 2 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,000	21/04/2023	41 500	(221)	(356)	(0,04)
							$ (3 360)	$ (9 214)	(1,08)

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/01/2053	$ 94,031	05/01/2023	8 500	$ (48)	$ (42)	(0,01)
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/01/2053	94,906	05/01/2023	13 000	(53)	(143)	(0,02)
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/01/2053	95,563	05/01/2023	27 000	(76)	(6)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/01/2053	96,906	05/01/2023	13 000	(49)	0	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/02/2053	94,906	06/02/2023	13 000	(67)	(90)	(0,01)
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	99,813	06/02/2023	300	(2)	(2)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	99,977	06/02/2023	13 500	(89)	(93)	(0,01)
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	100,000	06/02/2023	300	(2)	(2)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	101,813	06/02/2023	300	(2)	(1)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	102,000	06/02/2023	300	(2)	(1)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	102,438	06/02/2023	13 000	(73)	(14)	0,00
JPM	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/03/2053	95,250	06/03/2023	26 000	(292)	(582)	(0,07)
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	97,000	06/03/2023	900	(8)	(14)	0,00

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	$ 97,156	06/03/2023	900	$ (8)	$ (15)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	99,000	06/03/2023	900	(7)	(2)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	99,156	06/03/2023	900	(6)	(2)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	98,766	06/03/2023	2 700	(23)	(37)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	100,766	06/03/2023	2 700	(19)	(9)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/03/2053	99,766	06/03/2023	6 500	(45)	(65)	(0,01)
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/03/2053	99,781	06/03/2023	6 500	(45)	(65)	(0,01)
MSC	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/01/2053	94,031	05/01/2023	17 000	(96)	(84)	(0,01)
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/01/2053	94,703	05/01/2023	1 000	(2)	(1)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/01/2053	95,266	05/01/2023	21 000	(75)	(9)	0,00
SAL	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/01/2053	96,031	05/01/2023	15 000	(80)	(1)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/02/2053	98,563	06/02/2023	9 000	(67)	(82)	(0,01)
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	97,578	06/03/2023	500	(4)	(5)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	99,578	06/03/2023	500	(3)	(4)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	100,000	06/02/2023	12 300	(81)	(86)	(0,01)
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	100,063	06/02/2023	27 000	(177)	(196)	(0,02)
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	102,000	06/02/2023	24 800	(142)	(44)	(0,01)
					$ (1 643)	$ (1 697)	(0,20)

[1] Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 448	$ 550	$ 11	$ 0	$ 11	0,00
CBK	01/2023	$ 898	€ 847	6	0	6	0,00
MBC	01/2023	AUD 200	$ 135	0	0	0	0,00
	01/2023	€ 24 813	25 982	0	(512)	(512)	(0,06)
	01/2023	£ 109 852	133 883	1 722	0	1 722	0,20
	01/2023	$ 427	€ 402	2	0	2	0,00
MYI	01/2023	AUD 873	$ 586	0	(6)	(6)	0,00
	01/2023	$ 21	£ 18	0	0	0	0,00
				$ 1 741	$ (518)	$ 1 223	0,14

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CAD (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 5 714	CAD 7 726	$ 0	$ (11)	$ (11)	0,00
BRC	01/2023	CAD 4	$ 3	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	$ 4 088	CAD 5 524	0	(11)	(11)	0,00
MBC	01/2023	5 895	7 982	0	(4)	(4)	0,00
MYI	01/2023	24	32	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	1 641	2 204	0	(14)	(14)	(0,01)
				$ 0	$ (40)	$ (40)	(0,01)

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 1 262	CHF 1 194	$ 29	$ 0	$ 29	0,00
CBK	01/2023	2 128	2 011	47	0	47	0,01
MBC	01/2023	CHF 36	$ 38	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 20	CHF 19	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	CHF 36	$ 38	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 27	CHF 25	0	0	0	0,00
				$ 76	$ (1)	$ 75	0,01

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution et E en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 260	€ 247	$ 3	$ 0	$ 3	0,00
BPS	01/2023	€ 619	$ 661	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 27	€ 25	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	€ 5 744	$ 6 104	0	(29)	(29)	0,00
	01/2023	$ 78 035	€ 75 239	2 298	0	2 298	0,27
CLY	01/2023	2 878	2 705	11	0	11	0,00
MBC	01/2023	€ 289	$ 305	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	$ 79 195	€ 75 549	1 470	0	1 470	0,17
SCX	01/2023	76 925	73 906	1 985	0	1 985	0,24
				$ 5 767	$ (33)	$ 5 734	0,68

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 49	$ 59	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
BRC	01/2023	18	21	0	0	0	0,00
JPM	01/2023	$ 5 467	£ 4 527	0	(20)	(20)	0,00
MBC	01/2023	£ 89	$ 109	1	0	1	0,00
	01/2023	$ 5 552	£ 4 633	24	(2)	22	0,00
MYI	01/2023	£ 34	$ 42	1	0	1	0,00
TOR	01/2023	$ 5 442	£ 4 526	4	0	4	0,00
UAG	01/2023	£ 5	$ 6	0	0	0	0,00
				$ 31	$ (22)	$ 9	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie E en SGD (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 126	SGD 173	$ 3	$ 0	$ 3	0,00
BPS	01/2023	SGD 0	$ 0	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 129	SGD 177	3	0	3	0,00
BRC	01/2023	SGD 221	$ 163	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$ 3	SGD 4	0	0	0	0,00
GLM	01/2023	18	24	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	SGD 342	$ 254	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 135	SGD 185	3	0	3	0,00
				$ 9	$ (3)	$ 6	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ 25 125**	**2,96**

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Ginnie Mae, TBA			
2,000 % éch. 01/02/2053	$ 7 900	$ (6 629)	(0,78)
2,500 % éch. 01/01/2053	11 500	(9 969)	(1,17)
4,000 % éch. 01/01/2053	4 800	(4 543)	(0,54)
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
2,000 % éch. 01/01/2038	27 900	(24 818)	(2,92)
2,000 % éch. 01/01/2053	63 550	(51 725)	(6,09)
2,000 % éch. 01/02/2053	198 000	(161 328)	(19,00)
2,500 % éch. 01/01/2053 (g)	15 000	(12 705)	(1,50)
3,000 % éch. 01/01/2038	2 000	(1 873)	(0,22)
3,000 % éch. 01/02/2053	170 650	(149 936)	(17,66)
3,500 % éch. 01/01/2053	3 500	(3 180)	(0,37)
4,000 % éch. 01/01/2038	3 700	(3 607)	(0,43)
4,000 % éch. 01/01/2053	32 200	(30 203)	(3,56)
4,500 % éch. 01/01/2053	4 250	(4 091)	(0,48)
5,000 % éch. 01/02/2053	54 400	(53 605)	(6,31)
Total des Titres vendus à découvert		**$ (518 212)**	**(61,03)**
Total des Investissements		**$ 1 250 906**	**147,31**
Autres actifs et passifs à court terme		**$ (401 758)**	**(47,31)**
Actif net		**$ 849 148**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

***** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à principal uniquement.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(e) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

(f) Affilié au Fonds.

(g) Les titres vendus à découvert au 31 décembre 2022 sont couverts par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.

(h) Des titres d'une juste valeur globale de 324 164 $ (31 décembre 2021 : 375 312 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 94 $) et un montant en numéraire de 4 656 $ (31 décembre 2021 : 0 $) ont été reçus en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un titre d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 664 $) et un montant en numéraire de 4 327 $ (31 décembre 2021 : 26 671 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 4 020 $ (31 décembre 2021 : 2 840 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 1 723 820	$ 1 179	$ 1 724 999
Fonds d'investissement	23	0	0	23
Contrats de mise en pension	0	17 318	0	17 318
Instruments financiers dérivés[3]	0	26 778	0	26 778
Titres vendus à découvert	0	(518 212)	0	(518 212)
Totaux	**$ 23**	**$ 1 249 704**	**$ 1 179**	**$ 1 250 906**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 2 953 139	$ 1 459	$ 2 954 598
Fonds d'investissement	93 049	0	0	93 049
Contrats de mise en pension	0	2 125	0	2 125
Instruments financiers dérivés[3]	1 373	35 920	0	37 293
Titres vendus à découvert	0	(640 730)	0	(640 730)
Totaux	**$ 94 422**	**$ 2 350 454**	**$ 1 459**	**$ 2 446 335**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	En % de l'actif net
CIB	4,460 %	13/12/2022	12/01/2023	$ (263 491)	$ (264 111)	(31,10)
JPS	4,820	03/11/2022	06/02/2023	(718)	(724)	(0,09)
RCY	4,480	13/12/2022	12/01/2023	(23 137)	(23 192)	(2,73)
SCX	2,310	14/11/2022	16/02/2023	€ (26 592)	(28 466)	(3,35)
Total des Contrats de prise en pension					**$ (316 493)**	**(37,27)**

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ (3 187)	$ 2 810	$ (377)	$ (352)	$ 460	$ 108
BPS	3 438	(3 310)	128	3 572	(2 870)	702
BRC	500	(480)	20	8	0	8
CBK	11 235	(10 950)	285	(465)	0	(465)
CLY	11	0	11	S/O	S/O	S/O
DUB	6 229	(5 990)	239	S/O	S/O	S/O
FBF	S/O	S/O	S/O	67	(220)	(153)
GLM	1 201	(1 080)	121	(395)	610	215
GSC	S/O	S/O	S/O	(30)	0	(30)
GST	S/O	S/O	S/O	151	0	151
HUS	S/O	S/O	S/O	(2 383)	1 750	(633)
JPM	(743)	730	(13)	395	(280)	115
JPS	S/O	S/O	S/O	(5)	(650)	(655)
MBC	2 699	(2 490)	209	S/O	S/O	S/O
MSC	(94)	0	(94)	S/O	S/O	S/O
MYC	2 285	(2 410)	(125)	2 940	(3 626)	(686)
MYI	(6)	0	(6)	70	20	90
RBC	S/O	S/O	S/O	1 093	(710)	383

Tableau des investissements Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite)

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
SAL	$ (418)	$ 480	$ 62	$ 679	$ (550)	$ 129
SCX	1 971	(1 850)	121	5 399	(4 320)	1 079
TOR	4	0	4	1 214	(950)	264
UAG	S/O	S/O	S/O	2 361	(1 570)	791

[1] L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	25,41	21,88
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	174,84	108,20
Autres valeurs mobilières	2,90	1,91
Fonds d'investissement	0,00	4,16
Contrats de mise en pension	2,04	0,09
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,54	0,12
Instruments financiers dérivés compensés	(0,35)	0,91
Instruments financiers dérivés hors cote	2,96	0,64
Titres vendus à découvert	(61,03)	(28,62)
Contrats de prise en pension	(37,27)	(16,26)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Obligations et billets privés	0,10	0,85
Obligations et billets municipaux	S/O	0,06
Agences du gouvernement américain	121,51	76,22
Obligations du Trésor américain	0,51	0,13
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	37,20	26,71
Titres adossés à des actifs	35,71	28,02
Instruments à court terme	8,12	S/O
Fonds d'investissement	0,00	4,16
Contrats de mise en pension	2,04	0,09
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,54	0,12
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de taux d'intérêt	(0,35)	0,91
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	3,42	0,28
Options sur titres	0,00	0,15
Options vendues		
Swaptions de taux d'intérêt	(1,08)	(0,21)
Options sur titres	(0,20)	(0,13)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	S/O	0,06
Swaps de taux d'intérêt	S/O	0,00
Contrats de change à terme	0,14	(0,16)
Contrats de change à terme couverts	0,68	0,65
Titres vendus à découvert	(61,03)	(28,62)
Autres actifs et passifs à court terme	(47,31)	(9,29)
Actif net	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				
American Tower Corp.				
1,450 % éch. 15/09/2026	$	8 200	$ 7 165	0,71
3,800 % éch. 15/08/2029		1 305	1 187	0,11
Aroundtown S.A.				
5,375 % éch. 21/03/2029		6 500	4 928	0,49
Deutsche Bank AG				
1,375 % éch. 17/02/2032	€	15 000	11 685	1,16
GA Global Funding Trust				
5,085 % éch. 11/04/2025	$	6 800	6 649	0,66
Jackson National Life Global Funding				
5,473 % éch. 28/06/2024		2 200	2 201	0,22
Logicor Financing SARL				
2,250 % éch. 13/05/2025	€	6 000	5 860	0,58
			39 675	3,93
INDUSTRIE				
Broadcom, Inc.				
4,000 % éch. 15/04/2029	$	4 000	3 642	0,36
DAE Funding LLC				
3,375 % éch. 20/03/2028		2 800	2 490	0,25
Hyatt Hotels Corp.				
1,800 % éch. 01/10/2024		4 600	4 313	0,43
IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % en numéraire ou 7,125 % de rémunération en nature)				
6,375 % éch. 15/05/2029 (b)		1 200	1 016	0,10
Imperial Brands Finance PLC				
3,125 % éch. 26/07/2024		200	191	0,02
3,500 % éch. 26/07/2026		3 243	2 978	0,29
Nissan Motor Co. Ltd.				
3,522 % éch. 17/09/2025		2 000	1 860	0,18
4,345 % éch. 17/09/2027		1 600	1 453	0,14
4,810 % éch. 17/09/2030		1 600	1 362	0,13
Quanta Services, Inc.				
0,950 % éch. 01/10/2024		6 300	5 806	0,58
Skyworks Solutions, Inc.				
0,900 % éch. 01/06/2023		100	98	0,01
1,800 % éch. 01/06/2026		100	88	0,01
Warnermedia Holdings, Inc.				
3,638 % éch. 15/03/2025		2 100	1 999	0,20
3,755 % éch. 15/03/2027		2 100	1 894	0,19
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.				
4,400 % éch. 15/03/2024		389	383	0,04
			29 573	2,93
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
Pacific Gas & Electric Co.				
3,000 % éch. 15/06/2028		500	433	0,05
4,550 % éch. 01/07/2030		900	818	0,08
			1 251	0,13
Total des Obligations et billets privés			70 499	6,99
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Fannie Mae				
1,991 % éch. 25/03/2037 (a)		260	20	0,00
2,889 % éch. 01/07/2044		2	2	0,00
3,000 % éch. 25/10/2040		731	679	0,07
3,462 % éch. 01/05/2038		199	202	0,02
3,465 % éch. 01/10/2034		0	0	0,00
3,481 % éch. 01/11/2035		3	3	0,00
3,506 % éch. 01/01/2036		283	289	0,03
3,775 % éch. 01/09/2035		8	8	0,00
3,805 % éch. 01/07/2035		4	3	0,00
5,059 % éch. 25/03/2038		346	344	0,03
Freddie Mac				
2,700 % éch. 01/05/2031		0	0	0,00
2,889 % éch. 25/02/2045		17	17	0,00
3,210 % éch. 15/07/2040		481	479	0,05
3,508 % éch. 01/06/2035		10	10	0,00
3,665 % éch. 15/03/2042		199	199	0,02
3,756 % éch. 01/09/2037		378	384	0,04
4,000 % éch. 01/01/2048		1 612	1 542	0,15
4,021 % éch. 01/09/2035		5	5	0,00
Ginnie Mae				
1,750 % éch. 20/10/2029		8	8	0,00
2,625 % éch. 20/08/2024 - 20/07/2027	$	12	$ 11	0,00
2,863 % éch. 20/01/2066		218	215	0,02
2,875 % éch. 20/04/2026 - 20/04/2041		163	161	0,02
3,000 % éch. 20/05/2047		335	317	0,03
3,379 % éch. 20/06/2067		692	689	0,07
3,430 % éch. 20/03/2066		380	376	0,04
4,542 % éch. 20/10/2065		4	4	0,00
4,612 % éch. 20/02/2066		5	4	0,00
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)				
6,500 % éch. 01/10/2036		30	31	0,00
			6 002	0,59
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
245 Park Avenue Trust				
3,508 % éch. 05/06/2037		12 203	10 873	1,08
American Home Mortgage Assets Trust				
4,769 % éch. 25/09/2046 ^		106	90	0,01
American Home Mortgage Investment Trust				
4,669 % éch. 25/03/2046		334	283	0,03
Ashford Hospitality Trust				
5,568 % éch. 15/04/2035		6 200	5 853	0,58
Avon Finance PLC				
4,331 % éch. 20/09/2048	£	2 361	2 786	0,28
Banc of America Funding Trust				
3,418 % éch. 25/05/2035	$	2	2	0,00
3,958 % éch. 20/02/2036		11	10	0,00
5,468 % éch. 26/10/2036		3 930	3 613	0,36
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust				
5,509 % éch. 15/07/2037		800	764	0,08
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
4,010 % éch. 25/01/2034		5	5	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,602 % éch. 25/11/2036		3 324	1 895	0,19
3,605 % éch. 25/01/2036 ^		50	46	0,00
3,609 % éch. 25/08/2036 ^		611	428	0,04
3,729 % éch. 25/09/2035 ^		7	4	0,00
3,764 % éch. 25/07/2035		892	632	0,06
5,964 % éch. 25/01/2035		1 481	1 322	0,13
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				
4,559 % éch. 25/06/2047		345	281	0,03
4,569 % éch. 25/10/2036		1 457	1 207	0,12
Bear Stearns Structured Products, Inc. Trust				
3,523 % éch. 26/01/2036 ^		2 124	1 708	0,17
5,219 % éch. 26/12/2046 ^		536	387	0,04
Braemar Hotels & Resorts Trust				
5,138 % éch. 15/06/2035		4 400	4 197	0,42
Bruegel DAC				
2,621 % éch. 22/05/2031	€	294	295	0,03
BX Trust				
5,338 % éch. 15/05/2035	$	7 010	6 773	0,67
Canada Square Funding PLC				
4,205 % éch. 17/06/2058	£	2 839	3 287	0,33
Citigroup Mortgage Loan Trust				
3,150 % éch. 25/10/2035 ^	$	35	33	0,00
3,885 % éch. 25/08/2035 ^		62	50	0,01
3,950 % éch. 25/05/2035		2	2	0,00
Commercial Mortgage Trust				
4,266 % éch. 10/07/2045		733	729	0,07
Countrywide Alternative Loan Trust				
3,048 % éch. 25/12/2035		689	560	0,06
4,543 % éch. 20/09/2046		2 739	2 602	0,26
4,548 % éch. 20/12/2046 ^		58	46	0,00
4,589 % éch. 25/04/2047		1 934	1 773	0,18
4,599 % éch. 25/04/2047		1 472	1 171	0,12
4,689 % éch. 25/06/2035 ^		928	648	0,06
4,709 % éch. 25/02/2047		73	62	0,01
4,749 % éch. 25/05/2047		263	222	0,02
4,809 % éch. 25/07/2046		3 941	3 436	0,34
5,750 % éch. 25/04/2037 ^		630	528	0,05
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
4,849 % éch. 25/05/2035		3 250	2 626	0,26
5,169 % éch. 25/02/2035		3 377	2 803	0,28
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.				
0,098 % éch. 25/06/2032		0	0	0,00
3,792 % éch. 25/03/2032		1	1	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates				
3,586 % éch. 27/12/2037	$	4 767	$ 4 344	0,43
Credit Suisse Mortgage Capital Trust				
1,115 % éch. 25/01/2060		2 189	1 758	0,17
2,688 % éch. 25/03/2059		1 687	1 602	0,16
3,850 % éch. 25/09/2057		9 724	9 363	0,93
5,068 % éch. 15/07/2032		870	821	0,08
DBWF Mortgage Trust				
5,789 % éch. 19/12/2030		1 400	1 347	0,13
Dutch Property Finance BV				
2,278 % éch. 28/04/2059	€	12 460	13 091	1,30
2,828 % éch. 28/04/2050		5 992	6 264	0,62
3,328 % éch. 28/04/2050		9 579	9 375	0,93
European Loan Conduit DAC				
2,803 % éch. 17/02/2030		2 738	2 795	0,28
Fingal Securities RMBS DAC				
2,578 % éch. 28/07/2055		1 101	1 172	0,12
FirstMac Mortgage Funding Trust				
5,021 % éch. 08/03/2049	$	69	69	0,01
Frost CMBS DAC				
2,952 % éch. 20/11/2033	€	4 894	4 943	0,49
GSR Mortgage Loan Trust				
4,739 % éch. 25/01/2034	$	1	1	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust				
3,321 % éch. 19/08/2036 ^		20	18	0,00
4,779 % éch. 19/05/2035		20	18	0,00
Hilton Orlando Trust				
5,618 % éch. 15/12/2034		9 170	8 882	0,88
Impac CMB Trust				
4,929 % éch. 25/05/2035		3 828	3 529	0,35
5,149 % éch. 25/10/2033		0	0	0,00
Independence Plaza Trust				
3,911 % éch. 10/07/2035		4 300	4 020	0,40
JPMorgan Alternative Loan Trust				
6,500 % éch. 25/03/2036 ^		1 447	844	0,08
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				
5,568 % éch. 15/02/2035		7 100	6 783	0,67
JPMorgan Mortgage Trust				
3,525 % éch. 25/04/2036 ^		659	579	0,06
Lehman XS Trust				
4,749 % éch. 25/11/2035		3 529	3 321	0,33
4,749 % éch. 25/07/2037 ^		9 593	8 594	0,85
4,929 % éch. 25/12/2035		4 882	4 243	0,42
London Wall Mortgage Capital PLC				
3,990 % éch. 15/05/2051	£	312	365	0,04
4,040 % éch. 15/05/2052		6 441	7 492	0,74
Luminent Mortgage Trust				
4,789 % éch. 25/10/2046	$	159	138	0,01
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				
2,848 % éch. 25/12/2046		9 971	7 488	0,74
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust				
4,798 % éch. 15/06/2030		5	5	0,00
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
3,139 % éch. 25/12/2034		5	5	0,00
4,385 % éch. 25/11/2035		4	3	0,00
4,809 % éch. 25/02/2036		7	6	0,00
4,849 % éch. 25/04/2029		124	112	0,01
5,885 % éch. 25/12/2029		129	119	0,01
Mortimer BTL PLC				
4,137 % éch. 23/06/2053	£	534	627	0,06
4,507 % éch. 21/06/2052		2 351	2 819	0,28
Nomura Resecuritization Trust				
5,289 % éch. 25/03/2037	$	3 691	3 485	0,35
Pierpont BTL PLC				
4,237 % éch. 22/12/2053	£	12 133	13 886	1,38
Polaris PLC				
4,222 % éch. 23/12/2058		1 805	2 119	0,21
Prime Mortgage Trust				
4,789 % éch. 25/02/2034	$	21	21	0,00
Primrose Residential DAC				
2,644 % éch. 24/03/2061	€	2 272	2 368	0,24
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
6,500 % éch. 25/08/2036	$	990	785	0,08
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				
3,910 % éch. 25/09/2035 ^		445	278	0,03

Tableau des investissements Fonds StocksPLUS™ Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Sequoia Mortgage Trust			
4,953 % éch. 20/12/2034	$ 276	$ 247	0,02
Shamrock Residential DAC			
2,744 % éch. 24/01/2061	€ 21 316	22 226	2,20
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
3,448 % éch. 25/01/2035 ^	$ 21	17	0,00
3,780 % éch. 25/02/2034	12	11	0,00
4,709 % éch. 25/10/2035	2 113	1 929	0,19
Structured Asset Mortgage Investments Trust			
3,448 % éch. 25/12/2035 ^	54	43	0,00
4,569 % éch. 25/09/2047	647	577	0,06
4,839 % éch. 19/07/2035	15	14	0,00
4,949 % éch. 25/02/2036 ^	8	6	0,00
Taurus DEU DAC			
3,281 % éch. 22/12/2030	€ 7 079	7 039	0,70
Taurus UK DAC			
4,101 % éch. 17/05/2031	£ 596	675	0,07
Tharaldson Hotel Portfolio Trust			
5,618 % éch. 11/11/2034	$ 3 159	3 005	0,30
Thornburg Mortgage Securities Trust			
5,029 % éch. 25/09/2043	368	345	0,03
Towd Point Mortgage Funding PLC			
4,471 % éch. 20/02/2054	£ 250	300	0,03
Verus Securitization Trust			
1,829 % éch. 25/10/2066	$ 6 418	5 415	0,54
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
2,748 % éch. 25/03/2047 ^	2 133	1 798	0,18
3,248 % éch. 25/11/2042	2	2	0,00
3,448 % éch. 25/08/2042	3	3	0,00
3,682 % éch. 25/08/2046 ^	27	24	0,00
3,813 % éch. 25/10/2035	240	220	0,02
4,929 % éch. 25/12/2045	6	6	0,00
4,969 % éch. 25/10/2045	3	3	0,00
5,309 % éch. 25/10/2044	457	413	0,04
5,369 % éch. 25/10/2045	1 985	1 827	0,18
5,549 % éch. 25/11/2045	957	849	0,08
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust			
2,803 % éch. 25/04/2036	1 717	1 616	0,16
		252 540	25,04
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS			
Aames Mortgage Investment Trust			
5,304 % éch. 25/10/2035	2 900	2 673	0,27
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust			
4,709 % éch. 25/10/2036	4 085	1 610	0,16
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
5,259 % éch. 25/11/2035	3 026	2 819	0,28
5,304 % éch. 25/09/2035	6 000	5 443	0,54
5,349 % éch. 25/10/2035	1 700	1 528	0,15
Ares European CLO DAC			
2,038 % éch. 15/10/2030	€ 1 196	1 246	0,12
2,158 % éch. 15/10/2031	1 000	1 034	0,10
Asset-Backed Funding Certificates Trust			
4,709 % éch. 25/11/2036	$ 6 217	2 822	0,28
Avoca CLO DAC			
2,198 % éch. 15/10/2032	€ 4 200	4 340	0,43
Bain Capital Euro CLO DAC			
2,196 % éch. 20/01/2032	700	728	0,07
Bavarian Sky S.A.			
2,448 % éch. 20/05/2027	1 084	1 158	0,11
2,448 % éch. 20/07/2029	9 582	10 240	1,02
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust			
4,709 % éch. 25/08/2036	$ 475	457	0,05
4,729 % éch. 25/12/2036	1 000	939	0,09
4,889 % éch. 25/05/2037	2 265	2 209	0,22
5,034 % éch. 25/12/2035	303	303	0,03
5,094 % éch. 25/01/2035	0	0	0,00
Black Diamond CLO DAC			
2,316 % éch. 20/01/2032	€ 964	1 006	0,10
2,500 % éch. 15/05/2032	$ 4 000	3 759	0,37
2,778 % éch. 15/05/2032	€ 20 700	21 419	2,12
2,834 % éch. 03/10/2029	40	43	0,00
4,793 % éch. 03/10/2029	$ 35	34	0,00
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC			
2,028 % éch. 15/07/2030	€ 438	457	0,05
Bumper NL BV			
3,110 % éch. 24/06/2031	€ 5 676	$ 6 071	0,60
Cairn CLO DAC			
2,158 % éch. 15/10/2031	600	627	0,06
2,178 % éch. 30/04/2031	1 184	1 233	0,12
2,275 % éch. 31/01/2030	438	459	0,05
Carlyle Euro CLO DAC			
2,078 % éch. 15/01/2031	800	833	0,08
2,688 % éch. 15/08/2032	5 700	5 909	0,59
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC			
2,338 % éch. 16/01/2033	7 400	7 605	0,75
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO Ltd.			
2,548 % éch. 15/11/2031	800	827	0,08
Carrington Mortgage Loan Trust			
5,379 % éch. 25/06/2035	$ 459	443	0,04
Chase Funding Trust			
5,129 % éch. 25/10/2032	2	2	0,00
CIT Mortgage Loan Trust			
5,739 % éch. 25/10/2037	766	762	0,08
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
6,039 % éch. 25/07/2037	850	845	0,08
Compartment VCL			
2,497 % éch. 21/09/2026	€ 650	694	0,07
Countrywide Asset-Backed Certificates			
4,789 % éch. 25/08/2034	$ 117	108	0,01
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust			
4,106 % éch. 25/01/2037	157	155	0,02
4,529 % éch. 25/08/2037	278	272	0,03
4,669 % éch. 25/02/2037	961	904	0,09
4,669 % éch. 25/03/2037	1 072	1 028	0,10
4,669 % éch. 25/12/2046	3 360	3 104	0,31
4,679 % éch. 25/10/2047	5 400	4 717	0,47
4,929 % éch. 25/03/2036	619	569	0,06
5,394 % éch. 25/10/2035	183	180	0,02
5,484 % éch. 25/07/2035	103	102	0,01
5,484 % éch. 25/04/2036 ^	11 300	10 579	1,05
6,339 % éch. 25/08/2035	2 000	1 800	0,18
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
4,598 % éch. 25/01/2032	2	2	0,00
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC			
5,964 % éch. 25/03/2046	1 500	1 369	0,14
CVC Cordatus Loan Fund DAC			
2,676 % éch. 15/09/2031	€ 900	935	0,09
Dryden Euro CLO DAC			
2,622 % éch. 15/05/2034	1 000	1 037	0,10
Ellington Loan Acquisition Trust			
5,439 % éch. 25/05/2037	$ 1 896	1 800	0,18
5,489 % éch. 25/05/2037	0	0	0,00
EquiFirst Mortgage Loan Trust			
6,114 % éch. 25/12/2034	449	426	0,04
FACT Master S.A.			
2,448 % éch. 20/07/2028	€ 2 060	2 197	0,22
First Franklin Mortgage Loan Trust			
4,869 % éch. 25/05/2036	$ 6 681	5 474	0,54
Fremont Home Loan Trust			
4,729 % éch. 25/02/2037	4 019	1 438	0,14
5,004 % éch. 25/11/2035	2 400	2 098	0,21
Gallatin CLO Ltd.			
5,328 % éch. 21/01/2028	427	423	0,04
GE-WMC Asset-Backed Pass-Through Certificates			
5,029 % éch. 25/12/2035	3 716	3 486	0,35
Greystone Commercial Real Estate Notes Ltd.			
5,498 % éch. 15/09/2037	1 464	1 442	0,14
GSAA Home Equity Trust			
4,889 % éch. 25/01/2036	1 023	392	0,04
GSAMP Trust			
4,529 % éch. 25/12/2036	1 028	557	0,06
4,689 % éch. 25/09/2036	2 834	1 049	0,10
4,869 % éch. 25/03/2046	686	661	0,07
5,289 % éch. 25/11/2035 ^	1 550	1 442	0,14
Harvest CLO DAC			
2,138 % éch. 15/07/2031	€ 900	928	0,09
2,775 % éch. 26/06/2030	386	403	0,04
Home Equity Asset Trust			
4,217 % éch. 25/10/2035	$ 2 900	2 768	0,27
4,689 % éch. 25/11/2036	0	0	0,00
4,689 % éch. 25/01/2037	2 940	2 507	0,25
4,859 % éch. 25/01/2036	$ 1 048	$ 987	0,10
HSI Asset Securitization Corp. Trust			
5,169 % éch. 25/01/2036	1 200	1 032	0,10
JPMorgan Mortgage Acquisition Corp.			
5,319 % éch. 25/12/2035	1 339	1 272	0,13
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust			
4,649 % éch. 25/06/2037	291	289	0,03
4,669 % éch. 25/03/2047	610	560	0,06
4,824 % éch. 25/05/2036	550	523	0,05
4,829 % éch. 25/07/2036	3 200	2 825	0,28
Jubilee CLO DAC			
1,978 % éch. 15/04/2030	€ 400	418	0,04
1,988 % éch. 15/04/2030	1 000	1 043	0,10
2,028 % éch. 15/04/2031	1 200	1 238	0,12
2,846 % éch. 15/12/2029	1 183	1 239	0,12
Laurelin DAC			
2,176 % éch. 20/10/2031	1 100	1 138	0,11
Long Beach Mortgage Loan Trust			
4,829 % éch. 25/02/2036	$ 1 141	1 101	0,11
4,949 % éch. 25/10/2034	5	4	0,00
4,989 % éch. 25/01/2036	365	331	0,03
5,304 % éch. 25/08/2035	3 000	2 685	0,27
Man GLG Euro CLO DAC			
2,058 % éch. 15/10/2030	€ 657	685	0,07
2,248 % éch. 15/01/2030	343	358	0,04
2,736 % éch. 15/12/2031	1 000	1 035	0,10
Marathon CLO Ltd.			
5,545 % éch. 21/11/2027	$ 42	42	0,00
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust			
4,519 % éch. 25/10/2036	745	656	0,07
4,889 % éch. 25/04/2036	1 840	1 722	0,17
5,244 % éch. 25/03/2034	1 146	1 116	0,11
5,304 % éch. 25/07/2034	1 122	1 093	0,11
5,304 % éch. 25/09/2034	1 604	1 508	0,15
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust			
4,709 % éch. 25/04/2036	203	145	0,01
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust			
4,569 % éch. 25/12/2036	1 916	776	0,08
Nomura Home Equity Loan, Inc. Home Equity Loan Trust			
5,019 % éch. 25/02/2036	1 477	1 335	0,13
Oak Hill European Credit Partners Ltd.			
2,356 % éch. 22/07/2030	€ 182	193	0,02
Option One Mortgage Loan Trust			
4,519 % éch. 25/07/2037	$ 4 231	2 398	0,24
4,609 % éch. 25/04/2037	2 111	1 542	0,15
Option One Mortgage Loan Trust Asset-Backed Certificates			
5,124 % éch. 25/11/2035	274	229	0,02
OZLME DAC			
2,927 % éch. 27/07/2032	€ 1 440	1 436	0,14
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates			
5,319 % éch. 25/05/2035	$ 4 326	3 822	0,38
5,559 % éch. 25/03/2035	2 100	1 809	0,18
5,709 % éch. 25/01/2036 ^	1 000	910	0,09
Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust			
5,259 % éch. 25/02/2036	1 700	1 529	0,15
RAAC Trust			
5,889 % éch. 25/09/2047	3 221	3 087	0,31
Residential Asset Mortgage Products Trust			
4,091 % éch. 25/05/2035	2 000	1 871	0,19
4,749 % éch. 25/08/2046	3 200	2 816	0,28
4,929 % éch. 25/02/2036	1 200	1 127	0,11
Residential Asset Securities Corp. Trust			
4,669 % éch. 25/07/2036	1 200	1 124	0,11
Saxon Asset Securities Trust			
5,289 % éch. 26/12/2034	273	256	0,03
Silver Arrow Athlon NL BV			
2,162 % éch. 26/04/2031	€ 2 459	2 624	0,26
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust			
4,509 % éch. 25/03/2037	$ 4 897	2 942	0,29
4,889 % éch. 25/06/2037	6 001	3 596	0,36
5,364 % éch. 25/12/2035	129	126	0,01
Structured Asset Investment Loan Trust			
4,569 % éch. 25/09/2036	6 969	4 422	0,44
5,009 % éch. 25/01/2036	1 285	1 152	0,11
5,154 % éch. 25/08/2035	1 681	1 593	0,16

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust					
4,659 % éch. 25/03/2036	$	1 581	$	1 447	0,14
4,699 % éch. 25/08/2046		3 471		3 220	0,32
4,709 % éch. 25/10/2036		1 692		1 148	0,11
4,809 % éch. 25/02/2037		1 413		1 362	0,14
Toro European CLO DAC					
2,572 % éch. 15/02/2034	€	5 100		5 250	0,52
Washington Mutual Asset-Backed Certificates Trust					
4,699 % éch. 25/08/2036	$	949		885	0,09
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust					
4,884 % éch. 25/05/2036		510		506	0,05
				230 507	22,85

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
INSTRUMENTS À COURT TERME					
BILLETS À COURT TERME					
Federal Home Loan Bank					
4,310 % éch. 03/01/2023	$	15 400	$	15 400	1,53
4,310 % éch. 04/01/2023		15 600		15 600	1,54
4,310 % éch. 25/01/2023		13 900		13 901	1,38
4,320 % éch. 06/01/2023		11 000		11 000	1,09
				55 901	5,54
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN					
3,998 % éch. 19/01/2023 (c)(d)		96 400		96 245	9,54
Total des Instruments à court terme				152 146	15,08
Total des Valeurs mobilières			**$**	**711 694**	**70,55**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	9 317 030	$ 92 742	9,19
Total des Fonds d'investissement		**$ 92 742**	**9,19**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BOS	4,330 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 20 300	Obligations du Trésor américain 4,625 % échéance 15/02/2040	$ (20 745)	$ 20 300	$ 20 310	2,01
FICC	1,900	30/12/2022	03/01/2023	14 743	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 08/06/2023	(15 038)	14 743	14 745	1,46
NOM	4,320	30/12/2022	03/01/2023	60 000	Obligations du Trésor américain 2,500 % échéance 15/02/2046	(61 297)	60 000	60 029	5,95
SGY	4,290	30/12/2022	03/01/2023	24 500	Obligations du Trésor américain 3,250 % échéance 15/05/2042	(24 971)	24 500	24 512	2,43
TOR	4,080	21/12/2022	04/01/2023	CAD 50 000	Province de l'Ontario Canada 2,150 % échéance 02/06/2031	(36 902)	36 902	36 980	3,67
Total des Contrats de mise en pension						**$ (158 953)**	**$ 156 445**	**$ 156 576**	**15,52**

[1] Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini S&P 500 Index mars	Long	03/2023	2 046	$ (14 689)	(1,46)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	55	503	0,05
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Court	03/2023	95	92	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	137	(133)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Court	03/2023	412	125	0,01
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Court	03/2023	6	47	0,01
				$ (14 055)	(1,39)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ (14 055)**	**(1,39)**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AT&T, Inc.	1,000 %	20/12/2023	$ 6 300	$ (70)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2026	3 200	(53)	(0,01)
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2026	1 100	(18)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2023	7 400	(16)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2023	6 800	(36)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2026	1 800	(4)	0,00
Credit Suisse Group AG	1,000	20/12/2023	€ 9 800	0	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20/12/2024	$ 800	2	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	1 700	(3)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2026	3 700	(23)	0,00
Stellantis NV	5,000	20/06/2026	€ 5 600	(576)	(0,06)
Stellantis NV	5,000	20/12/2026	1 800	(170)	(0,02)
				$ (967)	(0,10)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION[2]

Indices/Tranches	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.HY-38 à 5 ans	(5,000) %	20/06/2027	$ 59 499	$ (2 798)	(0,28)
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	(5,000)	20/12/2027	9 800	(198)	(0,02)
				$ (2 996)	(0,30)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000 %	20/12/2027	$ 58 800	$ (14)	0,00
Indice iTraxx Asia Ex-Japan 38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	80	1	0,00
				$ (13)	0,00

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750 %	15/06/2024	$ 290 800	$ (2 252)	(0,22)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027	26 000	(332)	(0,03)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	54 600	1 118	0,11
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,875	07/02/2050	300	138	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	15/01/2050	900	423	0,04
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	20/03/2050	1 900	890	0,09
À recevoir	CPURNSA	2,418	11/07/2052	11 000	294	0,03
					$ 279	0,03
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ (3 697)**	**(0,37)**

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

Contrepartie	À payer/à recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel	Date d'échéance	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
FAR	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	677	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	$ 5 537	10/05/2023	$ 0	$ (21)	$ (21)	0,00
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	32 517	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	265 925	21/06/2023	0	(1 035)	(1 035)	(0,10)
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	2 731	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	22 334	02/08/2023	0	(87)	(87)	(0,01)
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	167	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	1 366	15/11/2023	0	(5)	(5)	0,00
MBC	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	3 736	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	30 553	07/06/2023	0	(120)	(120)	(0,01)
RBC	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	493	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	4 032	22/02/2023	0	(16)	(16)	0,00
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	680	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	5 561	17/05/2023	0	(22)	(22)	0,00
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	7 270	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	59 454	24/05/2023	0	(233)	(233)	(0,03)
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	24 342	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	199 069	19/07/2023	0	(779)	(779)	(0,08)
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	398	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	3 255	26/07/2023	0	(13)	(13)	0,00
UBS	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	1 109	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	9 069	13/09/2023	0	(35)	(35)	(0,01)
							$ 0	$ (2 366)	$ (2 366)	(0,24)

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BPS	01/2023	$ 553	€ 519	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	02/2023	62	ZAR 1 121	3	0	3	0,00
BRC	01/2023	1 715	€ 1 613	7	0	7	0,00
CBK	01/2023	€ 25 203	$ 26 683	0	(226)	(226)	(0,02)
	01/2023	ILS 5 099	1 618	173	0	173	0,02
	01/2023	$ 40	BRL 208	0	0	0	0,00
	01/2023	3 855	€ 3 668	61	0	61	0,01
	03/2023	371	MXN 7 281	0	(3)	(3)	0,00
GLM	01/2023	BRL 208	$ 40	1	0	1	0,00
	01/2023	CAD 50 078	36 789	0	(170)	(170)	(0,02)
	02/2023	$ 40	BRL 208	0	(1)	(1)	0,00
	03/2023	MXN 7 067	$ 344	0	(14)	(14)	0,00
	05/2023	$ 8	ZAR 132	0	0	0	0,00
JPM	01/2023	£ 54 271	$ 65 534	241	0	241	0,02
	01/2023	$ 19 124	€ 18 391	512	0	512	0,05
MBC	01/2023	CAD 227	$ 169	2	0	2	0,00
	01/2023	€ 216 323	226 722	0	(4 247)	(4 247)	(0,42)
	01/2023	$ 54 722	€ 52 261	1 077	0	1 077	0,11
	01/2023	30 284	£ 24 848	0	(389)	(389)	(0,04)
	01/2023	1 525	ILS 5 077	0	(86)	(86)	(0,01)
MYI	01/2023	€ 665	$ 710	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	SGD 10	7	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	NZD 212	132	0	(2)	(2)	0,00
	02/2023	$ 34	TWD 1 057	0	0	0	0,00
				$ 2 078	$ (5 139)	$ (3 061)	(0,30)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	€ 31 481	$ 32 960	$ 0	$ (653)	$ (653)	(0,06)
BOA	01/2023	27 599	29 038	0	(430)	(430)	(0,04)
BPS	01/2023	$ 440	€ 413	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	€ 13 479	$ 14 323	0	(68)	(68)	(0,01)
	01/2023	$ 96 382	€ 92 808	2 710	0	2 710	0,27
CLY	01/2023	€ 13 440	$ 14 296	0	(53)	(53)	(0,01)
MBC	01/2023	1 588	1 695	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 96 270	€ 91 853	1 802	0	1 802	0,18
MYI	01/2023	€ 16 698	$ 17 610	0	(218)	(218)	(0,02)
SCX	01/2023	$ 93 880	€ 90 195	2 422	0	2 422	0,24
				$ 6 934	$ (1 423)	$ 5 511	0,55

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 34	$ 42	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	01/2023	$ 1 621	£ 1 347	0	(1)	(1)	0,00
BRC	01/2023	£ 41	$ 50	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	70	85	1	0	1	0,00
	01/2023	$ 1 616	£ 1 349	7	0	7	0,00
MYI	01/2023	259	211	0	(5)	(5)	0,00
UAG	01/2023	1 522	1 267	2	0	2	0,00
				$ 11	$ (6)	$ 5	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 78	SGD 108	$ 2	$ 0	$ 2	0,00
BRC	01/2023	SGD 9	$ 7	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 89	SGD 121	2	0	2	0,00
MBC	01/2023	SGD 5	$ 4	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 92	SGD 125	1	0	1	0,00
SCX	01/2023	SGD 6	$ 4	0	0	0	0,00
				$ 5	$ 0	$ 5	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ 94**	**0,01**
Total des Investissements	**$ 943 223**	**93,51**
Autres actifs et passifs à court terme	**$ 65 516**	**6,49**
Actif net	**$ 1 008 739**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(e) Affilié au Fonds.

Un montant en numéraire de 45 395 $ (31 décembre 2021 : 119 116 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 4 781 $) et un montant en numéraire de 40 550 $ (31 décembre 2021 : 0 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 711 694	$ 0	$ 711 694
Fonds d'investissement	92 742	0	0	92 742
Contrats de mise en pension	0	156 445	0	156 445
Instruments financiers dérivés[3]	(14 139)	(3 519)	0	(17 658)
Totaux	**$ 78 603**	**$ 864 620**	**$ 0**	**$ 943 223**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 30 009	$ 2 312 617	$ 0	$ 2 342 626
Fonds d'investissement	342 388	0	0	342 388
Contrats de mise en pension	0	1 471 512	0	1 471 512
Instruments financiers dérivés[3]	29 744	39 536	0	69 280
Totaux	**$ 402 141**	**$ 3 823 665**	**$ 0**	**$ 4 225 806**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ (653)	$ 580	$ (73)	$ S/O	$ S/O	$ S/O
BOA	(428)	290	(138)	404	0	404
BPS	4	0	4	(1)	(90)	(91)
BRC	9	0	9	10	1	11
CBK	2 647	(2 506)	141	3 318	(24 685)	(21 367)
CLY	(53)	0	(53)	S/O	S/O	S/O
DUB	S/O	S/O	S/O	(23)	0	(23)
FAR	(1 148)	18 390	17 242	19 666	(33 480)	(13 814)
GLM	(184)	0	(184)	2 661	(2 650)	11
GST	S/O	S/O	S/O	(22)	(2 240)	(2 262)
HUS	S/O	S/O	S/O	1 637	(1 870)	(233)
JPM	753	(700)	53	(6)	0	(6)
MBC	(1 953)	3 760	1 807	S/O	S/O	S/O
MYC	S/O	S/O	S/O	(13)	(860)	(873)
MYI	(224)	0	(224)	31	5	36
RBC	(1 063)	16 910	15 847	18 153	(35 390)	(17 237)
SCX	2 420	(2 270)	150	(5 902)	4 775	(1 127)
TOR	S/O	S/O	S/O	1 959	(1 230)	729
UAG	2	620	622	9 319	(9 600)	(281)
UBS	(35)	0	(35)	S/O	S/O	S/O

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	33,61	30,73
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	35,70	31,01
Autres valeurs mobilières	1,24	0,55
Fonds d'investissement	9,19	9,10
Contrats de mise en pension	15,52	39,12
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(1,39)	0,77
Instruments financiers dérivés compensés	(0,37)	(0,29)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,01	1,36

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Obligations et billets privés	6,99	10,86
Agences du gouvernement américain	0,59	0,52
Obligations du Trésor américain	S/O	5,39
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	25,04	10,74
Titres adossés à des actifs	22,85	12,05
Actions ordinaires	S/O	0,80
Émissions souveraines	S/O	0,20
Instruments à court terme	15,08	21,73
Fonds d'investissement	9,19	9,10
Contrats de mise en pension	15,52	39,12
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(1,39)	0,77
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,10)	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection	(0,30)	S/O
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,00	0,01
Swaps de taux d'intérêt	0,03	(0,30)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Swaptions de taux d'intérêt	S/O	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	S/O	0,00
Swaps de rendement total sur indices	(0,24)	1,41
Contrats de change à terme	(0,30)	(0,20)
Contrats de change à terme couverts	0,55	0,15
Autres actifs et passifs à court terme	6,49	(12,35)
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				
Avolon Holdings Funding Ltd. 2,528 % éch. 18/11/2027	$	43	$ 34	0,36
CPI Property Group S.A. 2,750 % éch. 12/05/2026	€	100	84	0,88
Goldman Sachs Group, Inc. 6,162 % éch. 15/03/2028	$	100	98	1,03
Nissan Motor Acceptance Co. LLC 2,750 % éch. 09/03/2028		50	41	0,43
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % éch. 01/10/2053	DKK	783	87	0,91
VICI Properties LP 3,750 % éch. 15/02/2027	$	100	91	0,96
Wells Fargo & Co. 1,338 % éch. 04/05/2025	€	100	103	1,08
			538	5,65
INDUSTRIE				
Aker BP ASA 3,000 % éch. 15/01/2025	$	150	142	1,49
Expedia Group, Inc. 6,250 % éch. 01/05/2025		44	44	0,46
Warnermedia Holdings, Inc. 4,279 % éch. 15/03/2032		100	83	0,87
			269	2,82
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
Pacific Gas & Electric Co. 4,550 % éch. 01/07/2030		5	5	0,05
Total des Obligations et billets privés			812	8,52
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Freddie Mac 2,889 % éch. 25/02/2045		46	46	0,48
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,000 % éch. 01/02/2053		700	657	6,90
			703	7,38
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (c) 1,375 % éch. 15/02/2044		128	119	1,25
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
245 Park Avenue Trust 3,508 % éch. 05/06/2037		100	89	0,93
American Home Mortgage Assets Trust 2,968 % éch. 25/11/2046		239	76	0,80
Banc of America Alternative Loan Trust 6,000 % éch. 25/03/2021 ^		13	9	0,09
Banc of America Mortgage Trust 3,436 % éch. 25/06/2034		5	4	0,04
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust 3,232 % éch. 25/05/2037		11	11	0,11
Chase Mortgage Finance Trust 3,718 % éch. 25/07/2037		2	2	0,02
Countrywide Alternative Loan Trust 3,048 % éch. 25/12/2035	$	24	$ 21	0,22
5,500 % éch. 25/11/2035		16	11	0,12
5,915 % éch. 25/11/2035		36	19	0,20
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust 4,849 % éch. 25/05/2035		84	68	0,71
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust 4,540 % éch. 25/11/2034		11	11	0,12
Dutch Property Finance BV 2,828 % éch. 28/04/2050	€	75	78	0,82
Frost CMBS DAC 2,952 % éch. 20/11/2033		100	101	1,06
GSR Mortgage Loan Trust 3,719 % éch. 25/11/2035	$	17	15	0,16
Mortgage Equity Conversion Asset Trust 5,130 % éch. 25/02/2042		116	108	1,13
Precise Mortgage Funding PLC 4,587 % éch. 12/12/2055	£	77	93	0,98
Shamrock Residential DAC 2,744 % éch. 24/01/2061	€	90	94	0,99
Structured Asset Mortgage Investments Trust 4,839 % éch. 19/07/2035	$	23	21	0,22
5,009 % éch. 25/09/2045		12	10	0,10
Structured Asset Securities Corp. 4,669 % éch. 25/01/2036		12	11	0,12
4,739 % éch. 25/03/2035		43	40	0,42
			892	9,36
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Ares European CLO DAC 2,038 % éch. 15/10/2030	€	100	104	1,09
Armada Euro CLO DAC 2,098 % éch. 15/07/2031		100	104	1,09
Avoca CLO DAC 2,068 % éch. 15/07/2030		87	91	0,96
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 4,709 % éch. 25/08/2036	$	84	81	0,85
5,639 % éch. 25/08/2037		17	17	0,18
Carlyle Global Market Strategies Euro CLO DAC 2,338 % éch. 16/01/2033	€	100	103	1,08
Contego CLO DAC 2,142 % éch. 23/01/2030		100	104	1,09
Fremont Home Loan Trust 5,004 % éch. 25/11/2035	$	100	87	0,91
Griffith Park CLO DAC 2,522 % éch. 21/11/2031	€	100	103	1,08
GSAA Home Equity Trust 6,264 % éch. 25/02/2035	$	100	95	1,00
GSAMP Trust 4,529 % éch. 25/12/2036		143	78	0,82
Home Equity Loan Trust 4,619 % éch. 25/04/2037		77	74	0,78
HSI Asset Securitization Corp. Trust 5,169 % éch. 25/01/2036		100	86	0,90
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust 4,599 % éch. 25/10/2036		28	28	0,29
Jubilee CLO DAC 1,988 % éch. 15/04/2030	€	100	104	1,09
Man GLG Euro CLO DAC 2,248 % éch. 15/01/2030	€	57	$ 60	0,63
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust 5,244 % éch. 25/03/2034	$	72	70	0,74
Mountain View CLO Ltd. 5,291 % éch. 13/10/2027		250	248	2,60
Oak Hill European Credit Partners DAC 2,186 % éch. 20/01/2032	€	98	102	1,07
Palmer Square European Loan Funding DAC 3,993 % éch. 12/04/2032		100	106	1,11
Pretium Mortgage Credit Partners LLC 2,240 % éch. 27/09/2060	$	121	110	1,16
			1 955	20,52
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BONS DU TRÉSOR HONGROIS				
18,250 % éch. 03/01/2023 (a)(b)	HUF	18 000	48	0,50
BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN				
0,022 % éch. 04/01/2023 (a)(b)	ILS	100	28	0,30
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS				
(0,251) % éch. 11/01/2023 (a)(b)	¥	20 900	159	1,67
(0,228) % éch. 11/01/2023 (a)(b)		9 100	69	0,72
(0,160) % éch. 30/01/2023 (a)(b)		30 000	227	2,38
(0,159) % éch. 23/01/2023 (a)(b)		30 000	227	2,38
(0,147) % éch. 06/02/2023 (a)(b)		20 000	152	1,60
(0,138) % éch. 06/02/2023 (a)(b)		10 000	76	0,80
			910	9,55
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
4,290 % éch. 09/03/2023 (a)(b)	$	2 300	2 283	23,95
Total des Instruments à court terme			3 269	34,30
Total des Valeurs mobilières			**$ 7 750**	**81,33**

DESCRIPTION		ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT				
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)		53 037	528	5,54
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE				
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d)		3 800	376	3,95
Total des Fonds d'investissement			**$ 904**	**9,49**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BPS	4,310 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 1 200	Billets du Trésor américain 0,625 % échéance 15/05/2030	$ (1 227)	$ 1 200	$ 1 201	12,59
SSB	1,900	30/12/2022	03/01/2023	174	Billets du Trésor américain 1,875 % échéance 30/06/2026	(178)	174	174	1,83
Total des Contrats de mise en pension						**$ (1 405)**	**$ 1 374**	**$ 1 375**	**14,42**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	1	$ 9	0,10
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Long	03/2023	3	0	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Court	03/2023	4	1	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	14	(16)	(0,17)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Long	03/2023	1	(1)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	1	0	0,00
				$ (7)	(0,07)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ (7)**	**(0,07)**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.EM-38 à 5 ans	1,000 %	20/12/2027	$ 100	$ 3	0,02
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000	20/12/2027	200	10	0,11
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000	20/12/2027	4 100	31	0,33
				$ 44	0,46

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750 %	15/06/2027	$ 200	$ 9	0,09
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	200	9	0,09
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,407	21/07/2024	200	(15)	(0,15)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,500	16/06/2028	200	(23)	(0,25)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,740	15/02/2027	100	(13)	(0,14)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,000	16/12/2025	350	(39)	(0,40)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,000	16/12/2027	300	47	0,50
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	17/06/2030	100	24	0,25
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	16/06/2051	100	22	0,23
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,277	21/07/2031	200	38	0,40
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	18/12/2029	200	24	0,25
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,500	18/12/2024	100	10	0,11
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053	€ 100	8	0,08
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	300	(9)	(0,09)
					$ 92	0,97
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ 136**	**1,43**

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

Contrepartie	À payer/à recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel	Date d'échéance	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BRC	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	111	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	$ 908	04/10/2023	$ 0	$ (4)	$ (4)	(0,04)
FAR	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	170	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	1 390	10/05/2023	0	(5)	(5)	(0,05)
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	232	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	1 897	02/08/2023	0	(8)	(8)	(0,08)
	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	85	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	695	27/09/2023	0	(3)	(3)	(0,03)
RBC	À recevoir	Indice S&P 500 Total Return Index	569	LIBOR USD à 1 mois plus un écart donné	4 653	22/02/2023	0	(17)	(17)	(0,19)
							$ 0	$ (37)	$ (37)	(0,39)

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	DKK	600	$	84	$ 0	$ (2)	$ (2)	(0,02)
	01/2023	¥	60 000		416	0	(39)	(39)	(0,41)
	02/2023	€	13		14	0	0	0	0,00
	02/2023	£	91		107	0	(2)	(2)	(0,02)
	02/2023	$	7	€	7	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	HUF	3 983	$	10	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	BRL	1		0	0	0	0	0,00
	01/2023	ILS	100		32	3	0	3	0,03
	02/2023	PEN	97		24	0	(1)	(1)	(0,01)
	04/2023	$	20	PEN	79	1	0	1	0,01
CLY	01/2023	HUF	5 594	$	14	0	(1)	(1)	(0,01)
DUB	02/2023	€	1 357		1 406	0	(47)	(47)	(0,49)
GLM	01/2023	HUF	4 615		12	0	(1)	(1)	(0,01)
	01/2023	$	0	BRL	1	0	0	0	0,00
	02/2023	BRL	1	$	0	0	0	0	0,00
	03/2023	$	3	MXN	52	0	0	0	0,00
JPM	01/2023	HUF	2	$	0	0	0	0	0,00
MBC	02/2023	¥	30 000		208	0	(21)	(21)	(0,22)
MYI	01/2023	DKK	30		4	0	0	0	0,00
RBC	02/2023	$	17	£	14	0	0	0	0,00
	03/2023		0	MXN	0	0	0	0	0,00
	04/2023	MXN	44	$	2	0	0	0	0,00
RYL	01/2023	¥	30 000		202	0	(26)	(26)	(0,27)
	01/2023	$	4	PEN	16	0	0	0	0,00
SCX	02/2023	€	4	$	4	0	0	0	0,00
UAG	01/2023	HUF	2 979		8	0	0	0	0,00
						$ 4	$ (140)	$ (136)	(1,42)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	€	354	$	377	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
CBK	01/2023	$	116	€	112	4	0	4	0,04
JPM	01/2023	€	1	$	1	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	$	122	€	116	2	0	2	0,02
SCX	01/2023		119		115	3	0	3	0,03
UAG	01/2023		13		12	0	0	0	0,00
						$ 9	$ 0	$ 9	0,09

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£	2	$	2	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$	69	£	57	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	£	3	$	4	0	0	0	0,00
MBC	01/2023		2		3	0	0	0	0,00
	01/2023	$	69	£	58	0	0	0	0,00
MYI	01/2023		12		10	0	0	0	0,00
UAG	01/2023		64		54	0	0	0	0,00
						$ 0	$ 0	$ 0	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ (164)**	**(1,72)**

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
2,000 % éch. 01/01/2053	$ 300	$ (244)	(2,56)
2,500 % éch. 01/01/2053	400	(339)	(3,56)
Total des Titres vendus à découvert		**$ (583)**	**(6,12)**
Total des Investissements		**$ 9 410**	**98,76**
Autres actifs et passifs à court terme		**$ 118**	**1,24**
Actif net		**$ 9 528**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(c) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

(d) Affilié au Fonds.

Un montant en numéraire de 221 $ (31 décembre 2021 : 231 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 640 $ (31 décembre 2021 : 0 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 7 750	$ 0	$ 7 750
Fonds d'investissement	528	376	0	904
Contrats de mise en pension	0	1 374	0	1 374
Instruments financiers dérivés[3]	9	(44)	0	(35)
Titres vendus à découvert	0	(583)	0	(583)
Totaux	**$ 537**	**$ 8 873**	**$ 0**	**$ 9 410**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 9 467	$ 0	$ 9 467
Fonds d'investissement	1 103	0	0	1 103
Contrats de mise en pension	0	1 432	0	1 432
Instruments financiers dérivés[3]	0	195	0	195
Titres vendus à découvert	0	(305)	0	(305)
Totaux	**$ 1 103**	**$ 10 789**	**$ 0**	**$ 11 892**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ (43)	$ 0	$ (43)	$ 2	$ 0	$ 2
BRC	(4)	80	76	S/O	S/O	S/O
CBK	7	0	7	(1)	0	(1)
CLY	(1)	0	(1)	S/O	S/O	S/O
DUB	(47)	0	(47)	(1)	0	(1)
FAR	(16)	280	264	213	(270)	(57)
GLM	(1)	0	(1)	(1)	0	(1)
GST	S/O	S/O	S/O	(5)	(530)	(535)
HUS	S/O	S/O	S/O	7	0	7
JPM	S/O	S/O	S/O	2	0	2
MBC	(19)	0	(19)	S/O	S/O	S/O
RBC	(17)	280	263	1	0	1
RYL	(26)	0	(26)	S/O	S/O	S/O
SCX	3	0	3	4	0	4

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	20,10	30,90
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	61,13	48,72
Autres valeurs mobilières et instruments du marché monétaire	0,10	1,93
Fonds d'investissement	9,49	9,50
Contrats de mise en pension	14,42	12,33
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,07)	0,01
Instruments financiers dérivés compensés	1,43	(0,23)
Instruments financiers dérivés hors cote	(1,72)	1,90
Titres vendus à découvert	(6,12)	(2,63)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Obligations et billets privés	8,52	10,05
Agences du gouvernement américain	7,38	6,90
Obligations du Trésor américain	1,25	5,34
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	9,36	6,97
Titres adossés à des actifs	20,52	17,70
Émissions souveraines	S/O	0,20
Instruments à court terme	34,30	34,39
Fonds d'investissement	9,49	9,50
Contrats de mise en pension	14,42	12,33
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,07)	0,01
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,46	(0,01)
Swaps de taux d'intérêt	0,97	(0,22)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	S/O	0,05
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	S/O	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	S/O	(0,04)
Swaps de rendement total sur indices	(0,39)	1,79
Contrats de change à terme	(1,42)	0,04
Contrats de change à terme couverts	0,09	0,06
Titres vendus à découvert	(6,12)	(2,63)
Autres actifs et passifs à court terme	1,24	(2,43)
Actif net	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Avantor Funding, Inc.				
TBD % éch. 21/11/2024	$	0	$ 0	0,00
Avolon TLB Borrower (U.S.) LLC				
5,853 % éch. 12/02/2027		654	647	0,13
6,103 % éch. 15/01/2025		1 400	1 397	0,28
Carnival Corp.				
7,384 % éch. 30/06/2025		975	938	0,18
Emerald TopCo, Inc.				
7,884 % éch. 24/07/2026		40	36	0,01
Envision Healthcare Corp.				
TBD % éch. 29/04/2027 µ		138	136	0,03
TBD % éch. 29/04/2027		762	745	0,15
15,744 % éch. 28/04/2028		1 876	1 535	0,30
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
6,173 % éch. 22/06/2026		326	325	0,06
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
7,445 % éch. 01/02/2029	$	1 040	1 006	0,20
Lealand Finance Co. BV				
7,384 % éch. 28/06/2024		26	17	0,00
Lealand Finance Co. BV (5,384 % en numéraire ou 3,000 % de rémunération en nature)				
8,384 % éch. 30/06/2025 (b)		143	77	0,02
Poseidon BidCo S.A.S				
5,250 % - 7,452 % éch. 14/07/2028	€	1 900	1 747	0,34
PUG LLC				
7,884 % éch. 12/02/2027	$	45	37	0,01
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.				
8,165 % éch. 16/11/2025		87	82	0,02
SS&C European Holdings SARL				
6,134 % éch. 16/04/2025		57	56	0,01
SS&C Technologies, Inc.				
6,134 % éch. 16/04/2025		75	73	0,01
Sunshine Luxembourg SARL				
8,480 % éch. 01/10/2026		316	303	0,06
Syniverse Holdings, Inc.				
11,580 % éch. 13/05/2027		101	88	0,02
Windstream Services LLC				
10,673 % éch. 21/09/2027		20	19	0,00
			9 264	1,83
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,528 % éch. 18/11/2027		1 625	1 301	0,26
Banco de Credito del Peru S.A.				
4,650 % éch. 17/09/2024	PEN	1 100	269	0,05
Banco Espirito Santo S.A.				
2,625 % éch. 08/05/2017 ^	€	100	15	0,00
Barclays PLC				
7,250 % éch. 15/03/2023 (g)(i)	£	1 200	1 430	0,28
7,750 % éch. 15/09/2023 (g)(i)	$	1 200	1 175	0,23
Corestate Capital Holding S.A.				
3,500 % éch. 15/04/2023 ^	€	700	117	0,02
Credit Suisse AG				
6,500 % éch. 08/08/2023 (i)	$	1 915	1 859	0,37
Credit Suisse Group AG				
3,869 % éch. 12/01/2029		1 670	1 341	0,26
6,373 % éch. 15/07/2026		250	235	0,05
6,442 % éch. 11/08/2028		250	228	0,05
6,537 % éch. 12/08/2033		400	352	0,07
7,250 % éch. 12/09/2025 (g)(i)		200	144	0,03
7,500 % éch. 17/07/2023 (g)(i)		400	321	0,06
EPR Properties				
4,750 % éch. 15/12/2026		15	14	0,00
4,950 % éch. 15/04/2028		24	21	0,00
GLP Capital LP				
4,000 % éch. 15/01/2031		3 748	3 222	0,64
5,250 % éch. 01/06/2025		39	38	0,01
5,300 % éch. 15/01/2029		186	176	0,03
HSBC Holdings PLC				
3,973 % éch. 22/05/2030		1 700	1 491	0,29
Morgan Stanley				
0,000 % éch. 02/04/2032 (k)	$	700	$ 400	0,08
NatWest Group PLC				
4,445 % éch. 08/05/2030		1 200	1 089	0,22
4,892 % éch. 18/05/2029		500	474	0,09
5,076 % éch. 27/01/2030		1 400	1 322	0,26
Navient Corp.				
5,500 % éch. 25/01/2023		3 900	3 900	0,77
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab				
2,000 % éch. 01/10/2047	DKK	0	0	0,00
Nykredit Realkredit A/S				
2,000 % éch. 01/10/2047		0	0	0,00
Omega Healthcare Investors, Inc.				
3,625 % éch. 01/10/2029	$	110	90	0,02
OneMain Finance Corp.				
5,625 % éch. 15/03/2023		3 646	3 638	0,72
Park Aerospace Holdings Ltd.				
4,500 % éch. 15/03/2023		393	392	0,08
5,500 % éch. 15/02/2024		7	7	0,00
Sunac China Holdings Ltd.				
8,350 % éch. 19/04/2023 ^		200	44	0,01
Unique Pub Finance Co. PLC				
5,659 % éch. 30/06/2027	£	719	854	0,17
Voyager Aviation Holdings LLC				
8,500 % éch. 09/05/2026	$	33	26	0,01
			25 985	5,13
INDUSTRIE				
American Airlines Pass-Through Trust				
3,350 % éch. 15/04/2031		30	26	0,01
Boeing Co.				
5,805 % éch. 01/05/2050		1 200	1 119	0,22
5,930 % éch. 01/05/2060		1 300	1 191	0,24
Carvana Co.				
5,500 % éch. 15/04/2027		668	266	0,05
10,250 % éch. 01/05/2030		2 120	1 000	0,20
Community Health Systems, Inc.				
5,625 % éch. 15/03/2027		3 611	3 103	0,61
8,000 % éch. 15/03/2026		682	622	0,12
Energy Transfer LP				
4,950 % éch. 15/05/2028		25	24	0,00
Exela Intermediate LLC				
11,500 % éch. 15/07/2026		57	10	0,00
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.				
2,949 % éch. 24/01/2024	€	500	403	0,08
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
6,500 % éch. 15/03/2030	$	3 988	3 575	0,71
Market Bidco Finco PLC				
4,750 % éch. 04/11/2027	€	800	689	0,14
Marriott International, Inc.				
4,625 % éch. 15/06/2030	$	28	26	0,01
Melco Resorts Finance Ltd.				
5,375 % éch. 04/12/2029		930	748	0,15
Mitchells & Butlers Finance PLC				
6,013 % éch. 15/12/2030	£	25	28	0,01
Netflix, Inc.				
3,625 % éch. 15/06/2030	€	214	211	0,04
3,875 % éch. 15/11/2029		476	476	0,09
4,625 % éch. 15/05/2029		300	315	0,06
NMG Holding Co., Inc.				
7,125 % éch. 01/04/2026	$	700	657	0,13
Noble Finance Co. (11,000 % en numéraire ou 15,000 % de rémunération en nature)				
11,000 % éch. 15/02/2028 (b)		59	65	0,01
Petroleos de Venezuela S.A.				
5,375 % éch. 12/04/2027 ^		707	35	0,01
5,500 % éch. 12/04/2037 ^		762	37	0,01
6,000 % éch. 16/05/2024 ^		642	33	0,01
6,000 % éch. 15/11/2026 ^		518	25	0,01
9,750 % éch. 17/05/2035 ^		280	14	0,00
Petroleos Mexicanos				
6,700 % éch. 16/02/2032		4 318	3 399	0,67
Roadster Finance DAC				
2,375 % éch. 08/12/2032	€	100	80	0,02
Sands China Ltd.				
4,300 % éch. 08/01/2026	$	200	185	0,04
5,625 % éch. 08/08/2025		200	192	0,04
5,900 % éch. 08/08/2028	$	400	$ 375	0,07
Topaz Solar Farms LLC				
4,875 % éch. 30/09/2039		70	63	0,01
5,750 % éch. 30/09/2039		607	577	0,11
U.S. Renal Care, Inc.				
10,625 % éch. 15/07/2027		90	20	0,00
United Airlines Pass-Through Trust				
4,150 % éch. 11/10/2025		7	7	0,00
5,875 % éch. 15/04/2029		5 550	5 480	1,08
United Group BV				
4,875 % éch. 01/07/2024	€	100	100	0,02
Valaris Ltd. (8,250 % en numéraire ou 12,000 % de rémunération en nature)				
8,250 % éch. 30/04/2028 (b)	$	16	16	0,00
Western Midstream Operating LP				
5,041 % éch. 13/01/2023		60	60	0,01
Windstream Escrow LLC				
7,750 % éch. 15/08/2028		1 753	1 433	0,28
Wynn Macau Ltd.				
5,125 % éch. 15/12/2029		1 840	1 492	0,29
			28 177	5,56
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC				
2,950 % éch. 27/01/2029		5 100	3 545	0,70
Pacific Gas & Electric Co.				
2,950 % éch. 01/03/2026 ^		1 171	1 075	0,21
3,250 % éch. 15/06/2023 ^		625	618	0,12
3,250 % éch. 01/06/2031		2 460	2 006	0,40
3,300 % éch. 15/03/2027 ^		324	289	0,06
3,400 % éch. 15/08/2024 ^		403	387	0,08
3,450 % éch. 01/07/2025		1 102	1 044	0,21
3,500 % éch. 15/06/2025 ^		1 891	1 786	0,35
3,750 % éch. 01/07/2028		1 102	979	0,19
3,750 % éch. 15/08/2042 ^		20	14	0,00
4,000 % éch. 01/12/2046 ^		8	5	0,00
4,200 % éch. 01/03/2029		1 000	895	0,18
4,250 % éch. 15/03/2046 ^		6	4	0,00
4,300 % éch. 15/03/2045 ^		236	168	0,03
4,450 % éch. 15/04/2042 ^		145	108	0,02
4,500 % éch. 15/12/2041 ^		30	21	0,01
4,600 % éch. 15/06/2043 ^		56	43	0,01
4,750 % éch. 15/02/2044 ^		190	146	0,03
4,950 % éch. 01/07/2050		2 011	1 566	0,31
Petrobras Global Finance BV				
6,250 % éch. 14/12/2026	£	100	117	0,02
Rio Oil Finance Trust				
8,200 % éch. 06/04/2028	$	213	216	0,04
Sprint LLC				
7,625 % éch. 01/03/2026		47	50	0,01
Sprint LLC				
7,875 % éch. 15/09/2023		2 681	2 724	0,54
			17 806	3,52
Total des Obligations et billets privés			71 968	14,21
OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX				
Obligations Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2015				
7,750 % éch. 01/01/2042		7	7	0,00
Obligations Commonwealth of Puerto Rico General Obligation Bonds, Series 2022				
0,000 % éch. 01/11/2043		457	200	0,04
Obligations Illinois State General Obligation Bonds, (BABs), Series 2010				
6,630 % éch. 01/02/2035		30	31	0,01
7,350 % éch. 01/07/2035		14	15	0,00
Obligations Puerto Rico Electric Power Authority Revenue Bonds, (BABs), Series 2010				
6,125 % éch. 01/07/2040 ^		200	146	0,03
			399	0,08
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Fannie Mae				
1,611 % éch. 25/11/2049 (a)		113	15	0,00
3,634 % éch. 25/07/2033 (a)		46	4	0,00
Freddie Mac				
2,232 % éch. 15/06/2042 (a)		41	5	0,00
Ginnie Mae, TBA				
3,500 % éch. 01/02/2053		3 600	3 311	0,65

Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,000 % éch. 01/01/2053	$	2 300	$ 2 177	0,43
4,500 % éch. 01/01/2053		13 500	13 098	2,59
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)				
3,000 % éch. 01/03/2050		355	315	0,06
3,500 % éch. 01/04/2048 - 01/02/2050		548	506	0,10
4,000 % éch. 01/08/2039 - 01/05/2047		628	597	0,12
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				
2,500 % éch. 01/01/2053		3 600	3 049	0,60
3,000 % éch. 01/01/2038 - 01/02/2053		23 500	20 822	4,11
3,500 % éch. 01/02/2053		32 950	29 958	5,91
4,000 % éch. 01/01/2053		39 400	36 975	7,30
4,500 % éch. 01/02/2053		14 400	13 863	2,74
5,000 % éch. 01/01/2053		5 700	5 617	1,11
5,500 % éch. 01/02/2053		4 300	4 310	0,85
6,000 % éch. 01/01/2053		22 700	23 023	4,55
6,500 % éch. 01/01/2053		100	102	0,02
			157 747	31,14
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Obligations du Trésor américain				
2,875 % éch. 15/11/2046		2 200	1 765	0,35
3,000 % éch. 15/11/2045		4 800	3 953	0,78
3,000 % éch. 15/08/2048		20	17	0,00
3,000 % éch. 15/02/2049		3 500	2 884	0,57
3,125 % éch. 15/02/2043		114	97	0,02
3,375 % éch. 15/05/2044		20	18	0,00
3,625 % éch. 15/08/2043		372	342	0,07
3,625 % éch. 15/02/2044		280	257	0,05
3,750 % éch. 15/11/2043		160	150	0,03
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (f)				
0,125 % éch. 15/07/2024		3 464	3 352	0,66
0,125 % éch. 15/10/2024		2 416	2 327	0,46
0,125 % éch. 15/01/2031		114	102	0,02
0,125 % éch. 15/07/2031		111	98	0,02
0,250 % éch. 15/02/2050		1 159	783	0,16
0,375 % éch. 15/07/2023		3 726	3 682	0,73
0,500 % éch. 15/04/2024		3 296	3 206	0,63
0,625 % éch. 15/01/2024		4 393	4 300	0,85
0,625 % éch. 15/07/2032		3 077	2 820	0,56
0,750 % éch. 15/02/2042		132	110	0,02
0,750 % éch. 15/02/2045		1 012	820	0,16
0,875 % éch. 15/02/2047		1 234	1 013	0,20
1,000 % éch. 15/02/2046		503	428	0,08
1,000 % éch. 15/02/2048		1 571	1 324	0,26
1,000 % éch. 15/02/2049		3 801	3 181	0,63
1,375 % éch. 15/02/2044		128	119	0,02
2,125 % éch. 15/02/2041		136	144	0,03
Billets du Trésor américain				
1,250 % éch. 30/06/2028		14 000	12 109	2,39
1,500 % éch. 15/08/2026		200	182	0,04
2,250 % éch. 15/11/2025		1 030	975	0,19
2,375 % éch. 31/03/2029		3 200	2 910	0,57
2,625 % éch. 31/01/2026		9 200	8 793	1,74
2,625 % éch. 15/02/2029		160	148	0,03
2,750 % éch. 15/02/2028		600	564	0,11
2,875 % éch. 15/08/2028		120	113	0,02
2,875 % éch. 30/04/2029		8 700	8 149	1,61
2,875 % éch. 15/05/2032		630	581	0,12
4,000 % éch. 31/10/2029		3 600	3 602	0,71
			75 418	14,89
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
American Home Mortgage Assets Trust				
2,968 % éch. 25/11/2046		4 453	1 418	0,28
Banc of America Funding Corp.				
4,092 % éch. 25/09/2048		1 793	1 645	0,32
Banc of America Funding Trust				
2,888 % éch. 20/05/2036 ^		37	29	0,01
Bear Stearns Mortgage Funding Trust				
4,829 % éch. 25/08/2036		917	788	0,16
CitiMortgage Alternative Loan Trust				
6,000 % éch. 25/12/2036 ^		212	183	0,04
Countrywide Alternative Loan Trust				
4,669 % éch. 25/06/2037		1 884	1 646	0,33
5,500 % éch. 25/09/2035 ^		2 046	1 526	0,30
5,689 % éch. 25/10/2035 ^		243	172	0,03
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust				
5,049 % éch. 25/02/2035	$	630	$ 491	0,10
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				
6,500 % éch. 25/11/2034 ^		221	200	0,04
Eurosail PLC				
4,211 % éch. 13/09/2045	£	3 032	3 515	0,69
4,461 % éch. 13/06/2045		1 273	1 514	0,30
Greenpoint Mortgage Funding Trust				
4,789 % éch. 25/10/2046	$	411	363	0,07
Grifonas Finance PLC				
1,264 % éch. 28/08/2039	€	217	210	0,04
GSMPS Mortgage Loan Trust				
7,058 % éch. 20/10/2032	$	1 459	1 259	0,25
GSMSC Resecuritization Trust				
3,544 % éch. 26/04/2037		7 355	2 124	0,42
HomeBanc Mortgage Trust				
2,663 % éch. 25/04/2037		23	20	0,00
JPMorgan Mortgage Trust				
3,546 % éch. 25/08/2036 ^		35	28	0,01
3,850 % éch. 25/01/2037 ^		88	72	0,01
Legacy Mortgage Asset Trust				
6,139 % éch. 28/01/2070		1 703	1 701	0,34
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				
5,489 % éch. 25/09/2037		7 300	3 238	0,64
Morgan Stanley Capital Trust				
6,268 % éch. 15/07/2035		3 026	2 910	0,57
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust				
4,649 % éch. 25/04/2035		69	64	0,01
RBSGC Mortgage Loan Trust				
6,000 % éch. 25/01/2037 ^		18	15	0,00
Sandwell Commercial Finance PLC				
3,894 % éch. 30/09/2037	£	22	21	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,448 % éch. 25/05/2035 ^	$	122	93	0,02
3,637 % éch. 25/09/2035		58	42	0,01
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
2,509 % éch. 25/12/2046 ^		2 133	1 800	0,36
3,096 % éch. 25/08/2046		882	673	0,13
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
4,466 % éch. 25/05/2035 ^		305	260	0,05
Wells Fargo Alternative Loan Trust				
6,250 % éch. 25/07/2037 ^		970	813	0,16
Wells Fargo Mortgage-Backed Securities Trust				
4,511 % éch. 25/10/2036 ^		13	12	0,00
			28 845	5,69
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
4,869 % éch. 25/04/2036		6 811	6 143	1,21
Aegis Asset-Backed Securities Trust				
5,389 % éch. 25/03/2035 ^		578	535	0,11
Ameriquest Mortgage Securities Trust				
4,899 % éch. 25/04/2036		961	952	0,19
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,364 % éch. 25/07/2035		3 990	3 611	0,71
5,364 % éch. 25/09/2035		1 635	1 268	0,25
Argent Securities Trust				
4,689 % éch. 25/07/2036		5 316	4 598	0,91
Asset-Backed Funding Certificates Trust				
5,214 % éch. 25/08/2033		13	13	0,00
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
6,339 % éch. 25/11/2039		351	347	0,07
Castlelake Aircraft Securitization Trust				
4,125 % éch. 15/06/2043		600	527	0,10
Conseco Finance Corp.				
6,280 % éch. 01/09/2030		127	127	0,03
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,639 % éch. 25/11/2047 ^		5 057	4 455	0,88
4,649 % éch. 25/12/2036 ^		2 035	1 866	0,37
5,454 % éch. 25/08/2035		1 666	1 657	0,33
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				
3,103 % éch. 25/01/2037 ^		172	55	0,01
Fieldstone Mortgage Investment Trust				
4,256 % éch. 25/11/2036	$	1 810	$ 1 066	0,21
First Franklin Mortgage Loan Trust				
4,509 % éch. 25/12/2036		4 619	4 283	0,85
Fremont Home Loan Trust				
4,539 % éch. 25/01/2037		1 492	682	0,13
GSAMP Trust				
4,759 % éch. 25/03/2047		9 000	6 704	1,32
Harley Marine Financing LLC				
6,682 % éch. 15/05/2043		86	79	0,02
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust				
4,509 % éch. 25/04/2037		1 854	1 292	0,26
4,549 % éch. 25/11/2036		3 689	3 158	0,62
4,559 % éch. 25/04/2037		1 920	1 338	0,26
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
4,529 % éch. 25/01/2037		5 125	4 033	0,80
Long Beach Mortgage Loan Trust				
4,749 % éch. 25/03/2046		3 265	2 681	0,53
4,989 % éch. 25/01/2036		2 733	2 446	0,48
Madison Avenue Manufactured Housing Contract Trust				
7,639 % éch. 25/03/2032		584	584	0,12
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
4,909 % éch. 25/06/2036		374	337	0,07
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
3,549 % éch. 25/01/2035		1 009	942	0,19
4,499 % éch. 25/02/2037		735	358	0,07
4,539 % éch. 25/02/2037		2 279	1 111	0,22
4,639 % éch. 25/03/2037		8 273	3 741	0,74
New Century Home Equity Loan Trust				
5,169 % éch. 25/03/2035		72	66	0,01
6,414 % éch. 25/05/2034 ^		169	177	0,03
Park Place Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,709 % éch. 25/01/2036 ^		5 365	4 881	0,96
Renaissance Home Equity Loan Trust				
4,934 % éch. 25/08/2035		26	25	0,00
Saxon Asset Securities Trust				
6,139 % éch. 25/12/2037		1 856	1 713	0,34
Soundview Home Loan Trust				
4,854 % éch. 25/06/2036 ^		7 550	6 460	1,28
5,389 % éch. 25/09/2037		5 880	4 114	0,81
5,424 % éch. 25/05/2035		1 216	1 189	0,23
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
4,729 % éch. 25/12/2036		127	124	0,02
4,889 % éch. 25/11/2037		2 600	2 284	0,45
5,514 % éch. 25/07/2035		1 220	1 158	0,23
TruPS Financials Note Securitization Ltd.				
6,316 % éch. 20/09/2039		1 775	1 686	0,33
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
4,809 % éch. 25/03/2037		8	8	0,00
			84 874	16,75
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement argentin				
0,500 % éch. 09/07/2030			5 595	1 443	0,29
1,000 % éch. 09/07/2029			377	101	0,02
1,500 % éch. 09/07/2035			2 879	680	0,13
1,500 % éch. 09/07/2046			115	30	0,01
15,500 % éch. 17/10/2026	ARS		3 906	3	0,00
Obligation du Trésor argentin BONCER					
1,400 % éch. 25/03/2023			80 814	245	0,05
Obligation internationale du gouvernement australien					
1,750 % éch. 21/06/2051	AUD		2 200	865	0,17
Ville autonome de Buenos Aires					
72,986 % éch. 22/02/2028 (a)	ARS		27 495	78	0,02
Export-Credit Bank of Turkey					
8,250 % éch. 24/01/2024	$		200	203	0,04
Obligation internationale du gouvernement israélien					
3,800 % éch. 13/05/2060			2 400	1 888	0,37
Letras de la Nacion Argentina con Ajuste por CER					
0,000 % éch. 19/05/2023 (d)	ARS		154 637	470	0,09
Obligation internationale du gouvernement péruvien					
5,350 % éch. 12/08/2040	PEN		55	11	0,00
5,400 % éch. 12/08/2034			83	17	0,00
5,940 % éch. 12/02/2029			2 189	527	0,10

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
6,150 % éch. 12/08/2032	PEN	459	$ 106	0,02
6,350 % éch. 12/08/2028		410	102	0,02
6,950 % éch. 12/08/2031		6	1	0,00
8,200 % éch. 12/08/2026		1 040	286	0,06
Provincia de Buenos Aires				
72,913 % éch. 12/04/2025 (a)	ARS	14 289	39	0,01
Obligation internationale du gouvernement de la République hellénique				
3,500 % éch. 30/01/2023	€	31	33	0,01
3,750 % éch. 30/01/2028		58	62	0,01
3,900 % éch. 30/01/2033		61	63	0,01
4,000 % éch. 30/01/2037		36	36	0,01
4,200 % éch. 30/01/2042		11	12	0,00
Obligation internationale du gouvernement russe				
0,000 % éch. 24/04/2024	RUB	187 500	796	0,16
4,250 % éch. 23/06/2027 ^	$	800	280	0,06
4,750 % éch. 27/05/2026 ^		1 200	420	0,08
5,100 % éch. 28/03/2035 ^		200	66	0,01
5,250 % éch. 23/06/2047 ^		4 200	1 554	0,31
5,625 % éch. 04/04/2042 ^		1 800	1 143	0,23
5,875 % éch. 16/09/2043 ^		200	119	0,02
7,150 % éch. 12/11/2025	RUB	214 863	912	0,18
7,500 % éch. 31/03/2030 ^	$	202	131	0,03
7,950 % éch. 07/10/2026	RUB	82 843	352	0,07
12,750 % éch. 24/06/2028 ^	$	185	145	0,03
Obligation internationale du gouvernement sud-africain				
10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	102 900	6 393	1,26
Obligation internationale du gouvernement turc				
4,250 % éch. 13/03/2025	$	1 800	1 687	0,33
Bon du Trésor britannique				
1,250 % éch. 31/07/2051	£	110	72	0,01
1,500 % éch. 22/07/2047		50	37	0,01
1,750 % éch. 22/01/2049		100	77	0,02
3,250 % éch. 22/01/2044		90	96	0,02
3,500 % éch. 22/01/2045		90	100	0,02
Obligation internationale du gouvernement vénézuélien				
6,000 % éch. 09/12/2020 ^	$	289	20	0,00
7,000 % éch. 31/03/2038 ^		107	10	0,00
7,650 % éch. 21/04/2025 ^		266	23	0,00
8,250 % éch. 13/10/2024 ^		269	24	0,01
9,000 % éch. 07/05/2023 ^		144	13	0,00
9,250 % éch. 15/09/2027 ^		301	29	0,01
9,250 % éch. 07/05/2028 ^		256	23	0,00
11,750 % éch. 21/10/2026 ^		40	4	0,00
11,950 % éch. 05/08/2031 ^		400	38	0,01
12,750 % éch. 23/08/2022 ^		180	15	0,00
			21 880	4,32

ACTIONS

ACTIONS ORDINAIRES

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
SERVICES DE COMMUNICATION			
AT&T, Inc. (c)	56 547	1 041	0,21
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (c)	320 208	336	0,07
iHeartMedia, Inc. « A » (c)	75 157	461	0,09
iHeartMedia, Inc. « B » (c)	58 371	322	0,06
KDDI Corp. (c)	39 300	1 186	0,23
MTN Group Ltd.	69 898	521	0,10
Spark New Zealand Ltd.	55 192	188	0,04
Tele2 AB « B »	23 528	192	0,04
Telenor ASA	27 846	259	0,05
Telkom Indonesia Persero Tbk PT	1 504 600	362	0,07
Vodacom Group Ltd.	26 549	192	0,04
		5 060	1,00
BIENS DE CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE			
Astra International Tbk PT	822 200	301	0,06
Darden Restaurants, Inc. (c)	5 052	699	0,14
Garmin Ltd. (c)	4 118	380	0,08
Genuine Parts Co.	972	169	0,03
Industria de Diseno Textil S.A. (c)	24 323	644	0,13
Kia Corp. (c)	10 784	$ 507	0,10
LKQ Corp.	10 743	574	0,11
McDonald's Corp.	2 539	669	0,13
Mercedes-Benz Group AG	3 378	220	0,04
Stellantis NV	25 057	355	0,07
		4 518	0,89
BIENS DE CONSOMMATION COURANTE			
Altria Group, Inc.	73 644	3 366	0,67
Ambev S.A.	194 100	530	0,11
British American Tobacco PLC	30 003	1 181	0,23
Coca-Cola Co.	2 829	180	0,04
Coca-Cola HBC AG	8 328	196	0,04
General Mills, Inc. (c)	19 941	1 672	0,33
Imperial Brands PLC (c)	37 260	924	0,18
Japan Tobacco, Inc.	49 000	983	0,19
Jeronimo Martins SGPS S.A.	11 684	252	0,05
Kimberly-Clark Corp.	1 584	215	0,04
Koninklijke Ahold Delhaize NV	39 117	1 121	0,22
Kroger Co.	3 826	171	0,03
KT&G Corp. (c)	4 371	316	0,06
MEIJI Holdings Co. Ltd. (c)	4 400	224	0,05
Neiman Marcus Group Ltd. LLC (c)(k)	8 644	1 522	0,30
Nestle S.A.	7 585	876	0,17
Philip Morris International, Inc.	35 144	3 557	0,70
Procter & Gamble Co.	17 237	2 612	0,52
Tyson Foods, Inc. « A » (c)	5 832	363	0,07
		20 261	4,00
ÉNERGIE			
Chevron Corp.	2 011	361	0,07
China Shenhua Energy Co. Ltd. « H »	138 500	399	0,08
Coterra Energy, Inc.	9 853	242	0,05
Exxon Mobil Corp.	18 871	2 081	0,41
Marathon Oil Corp.	16 063	435	0,09
Marathon Petroleum Corp.	20 550	2 392	0,47
Noble Corp. PLC (c)	16 128	608	0,12
Petroleo Brasileiro S.A.	153 600	814	0,16
Polski Koncern Naftowy ORLEN S.A.	26 359	387	0,08
TotalEnergies SE (c)	13 067	818	0,16
Valero Energy Corp.	3 756	476	0,09
Yanzhou Coal Mining Co. Ltd. « H »	62 000	189	0,04
		9 202	1,82
SERVICES FINANCIERS			
3i Group PLC	32 118	515	0,10
Absa Group Ltd.	34 220	388	0,08
Aflac, Inc. (c)	24 741	1 780	0,35
Ageas S.A.	4 843	214	0,04
American International Group, Inc.	31 339	1 982	0,39
Ameriprise Financial, Inc.	3 708	1 155	0,23
AXA S.A.	30 827	856	0,17
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.	250 337	1 503	0,30
Banco do Brasil S.A.	35 400	229	0,05
Bank Mandiri Persero Tbk PT	763 200	487	0,10
Cairo Mezz PLC (c)	59 349	6	0,00
China Construction Bank Corp. « H »	2 864 000	1 791	0,35
Eurobank Ergasias Services and Holdings S.A. « A » (c)	712 189	800	0,16
Fifth Third Bancorp	13 423	$ 440	0,09
FirstRand Ltd.	208 597	757	0,15
Hartford Financial Services Group, Inc.	13 318	1 010	0,20
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. « H »	2 315 000	1 187	0,23
Intelsat Emergence S.A. (c)(k)	54 795	1 315	0,26
KeyCorp.	38 199	665	0,13
Manulife Financial Corp.	25 880	461	0,09
MetLife, Inc.	11 225	812	0,16
NN Group NV	11 512	469	0,09
PICC Property & Casualty Co. Ltd. « H »	284 000	269	0,05
Postal Savings Bank of China Co. Ltd. « H »	274 000	170	0,03
Principal Financial Group, Inc.	10 272	862	0,17
Regions Financial Corp.	38 215	824	0,16
Samsung Fire & Marine Insurance Co. Ltd. (c)	1 265	200	0,04
SpareBank 1 SR-Bank ASA	1 345	17	0,00
Stearns Holdings LLC « B » (c)	147 250	0	0,00
Synchrony Financial	19 855	653	0,13
U.S. Bancorp	4 075	178	0,04
Voyager Aviation Holdings LLC (c)	16	0	0,00
		21 995	4,34
SOINS DE SANTÉ			
AbbVie, Inc. (c)	7 510	1 214	0,24
Amgen, Inc. (c)	1 598	420	0,08
Chugai Pharmaceutical Co. Ltd.	23 000	583	0,11
CVS Health Corp. (c)	11 721	1 092	0,22
Elevance Health, Inc.	422	216	0,04
GSK PLC	23 829	410	0,08
Johnson & Johnson	25 517	4 508	0,89
Merck & Co., Inc.	35 862	3 979	0,79
Novartis AG	44 100	3 989	0,79
Orion Oyj « B »	4 401	240	0,05
Pfizer, Inc. (c)	81 685	4 185	0,83
Roche Holding AG	12 543	4 019	0,79
Sanofi	7 101	683	0,13
Sonic Healthcare Ltd.	10 407	211	0,04
		25 749	5,08
INDUSTRIE			
3M Co.	3 692	443	0,09
ACS Actividades de Construccion y Servicios S.A.	8 104	231	0,05
Airbus SE	1 738	206	0,04
AP Moller - Maersk A/S « A »	125	275	0,05
AP Moller - Maersk A/S « B »	202	451	0,09
Aurizon Holdings Ltd.	74 690	188	0,04
BAE Systems PLC	129 361	1 329	0,26
Bouygues S.A.	9 115	273	0,05
Brambles Ltd.	57 077	466	0,09
CITIC Ltd.	234 000	246	0,05
COSCO Shipping Holdings Co. Ltd. « H »	129 000	131	0,03
Eiffage S.A.	3 341	328	0,07
General Dynamics Corp. (c)	9 607	2 384	0,47
ITOCHU Corp. (c)	49 000	1 529	0,30
Kuehne + Nagel International AG	1 703	396	0,08
Mitsui & Co. Ltd. (c)	8 700	252	0,05
Mitsui OSK Lines Ltd. (c)	8 500	211	0,04
Nippon Yusen KK (c)	19 800	464	0,09

Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Obayashi Corp. (c)	26 200	$197	0,04
Thales S.A.	4 403	561	0,11
		10 561	2,09
TECHNOLOGIES DE L'INFORMATION			
Apple, Inc.	8 491	1 103	0,22
Broadcom, Inc.	3 325	1 859	0,37
Cisco Systems, Inc. (c)	81 770	3 896	0,77
Largan Precision Co. Ltd.	4 000	265	0,05
Lenovo Group Ltd.	284 000	231	0,04
MediaTek, Inc.	8 000	162	0,03
Microsoft Corp. (c)	714	171	0,03
NetApp, Inc. (c)	8 962	538	0,11
Novatek Microelectronics Corp.	24 000	245	0,05
Realtek Semiconductor Corp.	19 000	173	0,03
Unimicron Technology Corp.	51 000	198	0,04
United Microelectronics Corp.	487 000	640	0,13
		9 481	1,87
MATÉRIAUX			
Anglo American Platinum Ltd.	2 192	183	0,03
Anglo American PLC	24 551	957	0,19
BHP Group Ltd.	101 742	3 139	0,62
Dow, Inc.	11 730	591	0,12
Evraz PLC	72 869	0	0,00
Fortescue Metals Group Ltd.	69 888	973	0,19
Grupo Mexico S.A.B. de C.V. « B »	57 400	201	0,04
Impala Platinum Holdings Ltd.	34 424	432	0,08
LyondellBasell Industries NV « A »	5 469	454	0,09
Nitto Denko Corp. (c)	5 700	326	0,06
Petronas Chemicals Group Bhd.	97 200	190	0,04
Rio Tinto Ltd.	15 305	1 203	0,24
Rio Tinto PLC	27 945	1 957	0,39
Vale S.A.	54 300	920	0,18
Yara International ASA	6 839	299	0,06
		11 825	2,33
IMMOBILIER			
CK Asset Holdings Ltd.	82 500	506	0,10
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS			
EDP - Energias de Portugal S.A.	113 134	562	0,11
Elior Group S.A.	1 332	$189	0,04
Endesa S.A.	10 523	198	0,04
Hydro One Ltd.	6 698	179	0,04
Iberdrola S.A. (c)	62 661	729	0,14
NRG Energy, Inc.	9 551	304	0,06
Red Electrica Corp. S.A. (c)	16 213	281	0,06
Snam SpA (c)	80 844	391	0,08
SSE PLC (c)	8 647	177	0,03
Tokyo Gas Co. Ltd. (c)	16 200	315	0,06
		3 325	0,66
		122 483	24,18
DROITS			
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05/12/2025	11 842	84	0,02
BONS DE SOUSCRIPTION			
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31/12/2060	706	0	0,00
Intelsat Emergence S.A. - Exp. 17/02/2027	1 128	4	0,00
Windstream Holdings II, LLC - Exp. 21/09/2055	2 586	52	0,01
		56	0,01
TITRES PRIVILÉGIÉS			
Gerdau S.A. 0,000 %	47 700	262	0,05
Nationwide Building Society 10,250 %	6 220	937	0,19
Petroleo Brasileiro S.A. 0,000 %	195 100	906	0,18
Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	93	25	0,00
		2 130	0,42
SOCIÉTÉS D'INVESTISSEMENT IMMOBILIER			
Annaly Capital Management, Inc.	18 191	384	0,07
Apartment Income REIT Corp.	41 024	1 408	0,28
Apple Hospitality REIT, Inc.	74 265	1 172	0,23
CBL & Associates Properties, Inc.	378	9	0,00
Cousins Properties, Inc.	25 336	641	0,13
Digital Realty Trust, Inc.	6 878	690	0,14
EPR Properties	18 335	692	0,14
Equity Residential	11 957	$706	0,14
Gaming and Leisure Properties, Inc.	40 207	2 094	0,41
Healthcare Realty Trust, Inc.	63 315	1 220	0,24
Healthpeak Properties, Inc.	47 665	1 195	0,24
Highwoods Properties, Inc.	17 927	502	0,10
Hudson Pacific Properties, Inc.	120 717	1 175	0,23
Macerich Co.	50 425	568	0,11
National Storage Affiliates Trust	29 245	1 056	0,21
Physicians Realty Trust	49 855	721	0,14
Piedmont Office Realty Trust, Inc. « A »	54 014	495	0,10
Simon Property Group, Inc.	19 988	2 348	0,46
SITE Centers Corp.	92 403	1 262	0,25
Spirit Realty Capital, Inc.	30 528	1 219	0,24
Uniti Group, Inc.	2 036	11	0,00
Ventas, Inc.	27 689	1 625	0,32
VICI Properties, Inc.	129	4 187	0,83
Weyerhaeuser Co.	9 657	299	0,06
WP Carey, Inc.	15 526	1 213	0,24
		26 892	5,31

	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
4,397 % éch. 23/03/2023 (d)(e)	$ 8 600	8 520	1,68
Total des Instruments à court terme		8 520	1,68
Total des Valeurs mobilières		**$ 610 560**	**120,53**

	ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (h)	2 979 857	29 661	5,86
Total des Fonds d'investissement		**$ 29 661**	**5,86**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
FICC	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 781	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 29/06/2023	$ (797)	$ 781	$ 781	0,15
Total des Contrats de mise en pension						**$ (797)**	**$ 781**	**$ 781**	**0,15**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2024	15	$ 69	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2025	7	19	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Court	03/2026	8	21	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2024	10	34	0,01

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2025	9	$ 23	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2024	13	52	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2025	7	19	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2026	9	23	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2024	10	30	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois septembre	Court	12/2025	6	15	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars	Court	03/2023	103	456	0,09
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	4	3	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	44	401	0,08
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	4	(20)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	45	(2)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	650	(564)	(0,11)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Court	03/2023	156	(6)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Long	03/2023	11	(2)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	126	(39)	(0,01)
				$ 532	0,10

[1] Option de style contrat à terme standardisé.

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Nbre de Contrats	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	$ 98,000	15/12/2023	8	$ (7)	$ (1)	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	8	(7)	(24)	0,00
				$ (14)	$ (25)	0,00
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					**$ 507**	**0,10**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Boeing Co.	1,000 %	20/06/2026	$ 1 000	$ 5	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2023	300	16	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2025	€ 1 000	56	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20/06/2027	800	(7)	0,00
				$ 70	0,01

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.EM-29 à 5 ans	1,000 %	20/06/2023	$ 850	$ 17	0,00
Indice CDX.EM-30 à 5 ans	1,000	20/12/2023	3 145	145	0,03
Indice CDX.EM-31 à 5 ans	1,000	20/06/2024	946	33	0,01
Indice CDX.EM-32 à 5 ans	1,000	20/12/2024	510	19	0,00
Indice CDX.EM-34 à 5 ans	1,000	20/12/2025	2 208	(21)	0,00
Indice CDX.EM-36 à 5 ans	1,000	20/12/2026	6 808	24	0,00
Indice CDX.EM-38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	2 500	62	0,01
Indice CDX.HY-36 à 5 ans	5,000	20/06/2026	1 881	(115)	(0,02)
Indice CDX.HY-37 à 5 ans	5,000	20/12/2026	891	(21)	0,00
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000	20/12/2027	19 900	889	0,18
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000	20/12/2027	700	5	0,00
Indice iTraxx Asia Ex-Japan 38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	400	9	0,00
				$ 1 046	0,21

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000 %	15/03/2033	£ 6 900	$ (117)	(0,02)
À recevoir[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053	200	2	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,000	15/03/2029	¥ 2 430 000	814	0,16
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,020	20/09/2028	2 950 000	878	0,17
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,176	27/04/2027	160 000	(17)	0,00

Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,400 %	15/06/2032	¥ 410 000	$ 123	0,02
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,500	15/03/2042	220 000	143	0,03
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,711	27/04/2042	40 000	26	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2027	$ 15 700	(1 677)	(0,33)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2027	1 200	101	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2029	2 770	(356)	(0,07)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/12/2028	3 900	(527)	(0,10)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,250	15/06/2032	5 950	(727)	(0,14)
À recevoir[3]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,600	16/01/2026	6 600	157	0,03
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027	26 000	925	0,18
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2029	1 209	64	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	1 878	121	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2032	1 840	(192)	(0,04)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,817	05/04/2032	2 200	(296)	(0,06)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,872	06/04/2032	1 100	(143)	(0,03)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,928	25/03/2027	1 100	(81)	(0,02)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2027	1 250	9	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2029	4 630	38	0,01
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,000	21/12/2032	6 670	54	0,01
À recevoir[3]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,300	17/01/2026	4 600	109	0,02
À recevoir[3]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,350	17/01/2025	7 900	116	0,02
À recevoir[3]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,450	20/12/2024	15 900	238	0,05
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,850	30/08/2027	1 000	(36)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,955	04/10/2027	1 000	(30)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,050	07/09/2027	500	(14)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029	500	(15)	0,00
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,050	06/09/2032	700	(24)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,100	09/09/2029	500	(13)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,350	14/12/2032	200	4	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,610	12/12/2032	400	0	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,750	13/12/2027	900	2	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	5,830	02/01/2023	BRL 10 900	(37)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,836	02/01/2023	8 500	(28)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,855	02/01/2023	2 800	(9)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	6,170	02/01/2023	74 400	(695)	(0,14)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,140	02/01/2025	1 300	(8)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,160	02/01/2025	800	(5)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,220	04/01/2027	1 500	(11)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,245	04/01/2027	700	(5)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,260	04/01/2027	800	(6)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,350	02/01/2025	1 000	(5)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,700	04/01/2027	400	(2)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,715	04/01/2027	1 700	(8)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	11,870	04/01/2027	4 000	(15)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,000	02/01/2025	2 800	(8)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,080	02/01/2025	4 700	(12)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,140	02/01/2025	2 300	(5)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,145	02/01/2025	2 300	(5)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,160	02/01/2025	4 700	(11)	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,670	02/01/2023	3 800	2	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,690	02/01/2023	2 600	2	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,740	02/01/2023	6 500	3	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,750	02/01/2023	3 100	2	0,00

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel		Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,760 %	02/01/2023	BRL	6 400	$ 3	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,900	02/01/2023		13 300	3	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,930	02/01/2023		1 700	0	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,939	02/01/2023		6 700	1	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,946	02/01/2023		16 700	3	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,960	02/01/2023		13 300	2	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,970	02/01/2023		21 900	4	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,500	16/06/2026	$	32 900	3 337	0,66
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,500	16/06/2028		26 200	(3 046)	(0,60)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,750	15/12/2024		53 300	(4 188)	(0,83)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,750	16/06/2031		16 200	2 240	0,44
À payer	LIBOR USD à 3 mois	0,750	16/06/2031		13 442	(1 760)	(0,35)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	0,940	08/06/2026		2 000	214	0,04
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,000	16/12/2030		1 766	341	0,07
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,235	12/05/2028		700	97	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	15/12/2026		34 300	4 235	0,84
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,250	17/06/2027		12 000	(1 863)	(0,37)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	17/06/2030		47 620	6 063	1,21
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,250	16/06/2051		4 300	(1 008)	(0,20)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,270	04/11/2023		52 700	(1 654)	(0,33)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,350	20/01/2027		3 400	357	0,07
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,360	20/07/2031		800	149	0,03
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,370	19/07/2031		500	93	0,02
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,380	04/01/2027		1 400	(142)	(0,03)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,405	07/09/2031		1 300	239	0,05
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,425	18/01/2027		1 000	(99)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,443	18/01/2027		1 100	(109)	(0,02)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,450	17/02/2027		2 400	242	0,05
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,450	16/07/2031		1 200	217	0,04
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,491	21/01/2051		900	(322)	(0,06)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	15/12/2028		7 130	(1 078)	(0,21)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	12/01/2029		578	76	0,01
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,500	05/10/2031		600	(106)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,535	15/10/2031		600	(105)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,535	22/10/2031		400	(70)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,545	26/10/2031		400	(70)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,550	20/01/2027		15 100	(1 410)	(0,28)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,570	11/01/2027		800	(75)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,580	16/02/2027		900	(84)	(0,02)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,590	09/02/2051		7 200	(2 460)	(0,49)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,625	16/01/2050		3 100	1 060	0,21
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,625	03/02/2050		3 900	1 340	0,26
À payer[3]	LIBOR USD à 3 mois	1,700	06/03/2024		2 300	(73)	(0,01)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,700	17/02/2027		9 600	(834)	(0,16)
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,700	12/01/2029		2 100	(245)	(0,05)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,740	16/12/2026		1 100	103	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,750	22/01/2050		7 600	2 461	0,49
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,768	02/02/2032		300	(47)	(0,01)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,785	12/08/2051		700	230	0,05
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,875	07/02/2050		400	120	0,02
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,895	18/10/2049		700	225	0,04
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,910	17/10/2049		700	221	0,04
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,000	18/02/2032		900	(120)	(0,02)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	15/01/2050		1 400	392	0,08
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,000	15/12/2051		6 500	(2 289)	(0,45)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,250	11/12/2049		7 100	1 673	0,33
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,250	12/03/2050		3 400	780	0,15
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,500	18/12/2024		6 000	586	0,12
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,500	20/12/2024		10 900	203	0,04
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	3,000	19/06/2024		41 600	2 568	0,51
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	3,000	19/06/2026		32 300	2 292	0,45
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,710	23/11/2025	ZAR	10 000	2	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,750	19/09/2028		14 200	(30)	(0,01)
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	2,750	17/06/2026	AUD	460	(18)	0,00
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	3,000	21/03/2027		18 640	(978)	(0,19)
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	3,250	17/12/2024		1 600	(77)	(0,02)
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	3,500	17/06/2025		19 492	(1 182)	(0,23)
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,250	17/12/2024		650	(55)	(0,01)
À payer	BBR-BBSW AUD à 6 mois	4,750	18/06/2024		400	(40)	(0,01)
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,150	18/03/2030	€	6 200	1 332	0,26
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,250	18/03/2050		2 300	974	0,19
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,329	30/12/2025		100	11	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,363	30/06/2025		200	19	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,395	30/12/2024		100	8	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,425	28/06/2024		200	12	0,00
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,453	29/12/2023		200	8	0,00
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	0,830	09/12/2052		5 600	167	0,03
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033		3 800	109	0,02
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	2,000	21/09/2032		11 880	(1 414)	(0,28)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,160	06/06/2025	MXN	9 300	(46)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,535	04/05/2027		18 500	(115)	(0,02)

Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,795 %	02/06/2023	MXN 3 600	$ 9	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,950	30/01/2026	12 300	4	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,980	26/08/2024	500	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,990	30/01/2026	15 000	4	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,080	10/03/2026	20 700	3	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,350	01/09/2023	3 300	2	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,490	08/09/2026	13 700	(11)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,620	18/02/2030	600	(1)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,710	20/09/2029	500	(1)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,150	11/06/2027	28 100	(59)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,165	06/09/2032	3 000	(9)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,200	11/06/2027	2 900	(6)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,360	21/08/2037	3 100	(12)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,370	11/10/2027	14 800	(39)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,380	04/11/2026	400	(1)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,380	14/08/2037	700	1	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,480	18/06/2037	1 300	(5)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,495	14/01/2032	8 100	(1)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,498	15/01/2032	33 500	(7)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,520	18/04/2023	30 200	(14)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,530	18/04/2023	24 900	(12)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,530	21/04/2023	3 100	(2)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,545	18/04/2023	19 100	(10)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,603	14/04/2025	49 000	(106)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,610	23/01/2023	18 100	4	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,610	15/04/2025	3 000	(6)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,640	03/01/2023	2 200	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,645	03/01/2023	4 900	(1)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,670	05/03/2025	52 900	(107)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,700	02/05/2023	7 100	(3)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,710	07/03/2025	6 400	(13)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,715	07/03/2025	6 300	(13)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,745	05/01/2023	3 400	0	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,800	28/12/2027	2 900	6	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,805	06/02/2023	7 800	(2)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,818	17/02/2027	11 400	(38)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,820	06/02/2023	7 900	0	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,865	02/02/2027	11 900	(41)	(0,01)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,910	30/12/2027	600	1	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,984	10/12/2027	6 800	12	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,990	21/12/2027	100	0	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,005	21/12/2027	37 500	85	0,02
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,010	04/02/2027	5 200	(19)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,030	31/01/2028	4 600	8	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,050	31/01/2028	3 400	5	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,090	15/01/2027	13 000	(50)	(0,01)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,103	04/01/2038	5 600	12	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,120	15/01/2027	2 700	(11)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,410	31/03/2027	11 100	10	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,660	04/04/2024	38 500	48	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,675	03/04/2024	92 600	115	0,02
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,701	31/03/2032	19 500	2	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,730	06/04/2027	16 500	5	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,732	30/03/2032	8 200	0	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,750	05/04/2024	39 700	47	0,01
À payer	IPC Royaume-Uni	4,000	15/09/2031	£ 300	(43)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,020	15/10/2031	400	(55)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,055	15/09/2031	400	(57)	(0,01)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,066	15/09/2031	600	(74)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,140	15/10/2031	1 000	(123)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,250	15/11/2031	900	(88)	(0,02)
À payer	IPC Royaume-Uni	4,400	15/10/2031	400	(41)	(0,01)
					$ 5 695	1,12
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ 6 811**	**1,34**

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente - Indice iTraxx Europe 37 à 5 ans hors cote	Vente	3,000 %	15/03/2023	500	$ (1)	$ 0	0,00

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150 %	01/12/2023	1 100	$ (3)	$ (1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	01/12/2023	1 100	(3)	(8)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	19/01/2023	300	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,500	19/01/2023	300	(1)	(4)	0,00
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	11/04/2023	500	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	11/04/2023	500	(2)	(8)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	28/04/2023	1 300	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	28/04/2023	1 300	(2)	(18)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,150	09/01/2023	700	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	09/01/2023	700	(2)	(4)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,270	23/01/2023	300	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,770	23/01/2023	300	(1)	(1)	0,00
BRC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	19/01/2023	300	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,500	19/01/2023	300	(1)	(4)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200	12/01/2023	500	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	12/01/2023	500	(2)	(2)	0,00
CBK	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,690	02/04/2024	300	(2)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,690	02/04/2024	300	(2)	(4)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,150	09/01/2023	700	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	09/01/2023	700	(2)	(4)	0,00
DUB	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	1 000	(6)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	1 000	(6)	(14)	0,00
FAR	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,688	02/04/2024	600	(5)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,688	02/04/2024	600	(5)	(8)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,781	05/04/2024	1 000	(8)	(3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,781	05/04/2024	1 000	(8)	(12)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,920	13/10/2023	700	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,920	13/10/2023	700	(4)	(10)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,018	20/10/2023	500	(3)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,018	20/10/2023	500	(3)	(6)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,140	23/10/2023	500	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,140	23/10/2023	500	(4)	(6)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,190	23/10/2023	500	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,190	23/10/2023	500	(4)	(6)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,225	23/10/2023	500	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,225	23/10/2023	500	(3)	(5)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,973	25/10/2023	600	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,973	25/10/2023	600	(4)	(8)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,841	27/10/2023	600	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,841	27/10/2023	600	(4)	(8)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,088	03/11/2023	600	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,088	03/11/2023	600	(4)	(7)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,910	10/11/2023	600	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,910	10/11/2023	600	(4)	(8)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	17/11/2023	1 100	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	17/11/2023	1 100	(4)	(8)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	20/11/2023	1 100	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	20/11/2023	1 100	(4)	(8)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,250	07/12/2023	1 100	(3)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,750	07/12/2023	1 100	(3)	(7)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,697	02/04/2024	1 200	(9)	(4)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,697	02/04/2024	1 200	(9)	(15)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,721	08/04/2024	600	(5)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,721	08/04/2024	600	(5)	(7)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	05/04/2023	1 400	(3)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	05/04/2023	1 400	(3)	(22)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	11/04/2023	2 400	(5)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	11/04/2023	2 400	(5)	(36)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	24/04/2023	1 400	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	24/04/2023	1 400	(4)	(20)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,700	26/04/2023	1 300	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,250	26/04/2023	1 300	(2)	(18)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,550	15/05/2023	1 300	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,100	15/05/2023	1 300	(2)	(21)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547	07/03/2023	800	(18)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	800	(18)	(49)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	1 100	(13)	(3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	1 100	(15)	(36)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,230	23/01/2023	900	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,730	23/01/2023	900	(2)	(5)	0,00

Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
JPM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,200 %	12/01/2023	500	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 5 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,800	12/01/2023	500	(2)	(2)	0,00
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,993	11/10/2023	600	(4)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	2,993	11/10/2023	600	(4)	(8)	0,00
							$ (302)	$ (449)	(0,09)

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	$ 101,891	05/01/2023	600	$ (2)	$ 0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	99,813	06/02/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	100,000	06/02/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	101,813	06/02/2023	100	(1)	0	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	102,000	06/02/2023	100	(1)	0	0,00
JPM	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	97,000	06/03/2023	200	(2)	(3)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	97,156	06/03/2023	200	(2)	(3)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	99,000	06/03/2023	200	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	99,156	06/03/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	98,766	06/03/2023	200	(1)	(3)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	100,766	06/03/2023	200	(1)	(1)	0,00
SAL	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	97,578	06/03/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	99,578	06/03/2023	100	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	102,250	05/01/2023	300	(1)	0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	99,750	06/02/2023	600	(4)	(4)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	100,000	06/02/2023	200	(1)	(1)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	101,750	06/02/2023	600	(3)	(1)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	102,000	06/02/2023	200	(1)	0	0,00
					$ (26)	$ (21)	0,00

(1) Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000 %	20/12/2023	$ 400	$ (29)	$ 20	$ (9)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	100	(12)	6	(6)	0,00
BPS	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	200	(18)	4	(14)	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2023	100	(6)	6	0	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2026	300	(14)	0	(14)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2023	900	(62)	41	(21)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2024	400	(36)	19	(17)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	940	(110)	53	(57)	(0,01)
CBK	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2024	500	(9)	8	(1)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2024	200	(2)	1	(1)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2024	500	2	(7)	(5)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	100	(4)	(2)	(6)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2024	700	(11)	15	4	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	100	(10)	4	(6)	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2024	600	(9)	7	(2)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	100	(4)	(2)	(6)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	100	(9)	2	(7)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	800	(7)	13	6	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2027	700	(29)	20	(9)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	100	(5)	5	0	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/06/2024	400	(36)	19	(17)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement turc	1,000	20/12/2024	900	(101)	47	(54)	(0,01)
HUS	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/12/2023	200	(6)	6	0	0,00
	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2024	1 300	(38)	37	(1)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2023	3 200	(50)	68	18	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2023	100	(3)	4	1	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2026	300	(2)	3	1	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	800	(44)	45	1	0,00
MYC	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	200	(7)	(5)	(12)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	200	(18)	4	(14)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	600	(5)	9	4	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2025	100	(1)	1	0	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2026	1 100	3	(5)	(2)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/06/2027	400	(1)	(2)	(3)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2027	1 400	(49)	31	(18)	(0,01)
					$ (742)	$ 475	$ (267)	(0,05)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Indice ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110 %	25/05/2046	$ 330	$ (77)	$ 74	$ (3)	0,00
DUB	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	400	(7)	6	(1)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.7 Index	0,500	17/01/2047	382	(17)	17	0	0,00
FBF	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	25	0	0	0	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11/05/2063	3	0	0	0	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17/10/2057	100	(6)	6	0	0,00
GST	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	16 000	(8)	(28)	(36)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18/11/2054	7 300	(38)	3	(35)	(0,01)
	Indice CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11/05/2063	3	0	0	0	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17/10/2057	8 600	(339)	347	8	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17/09/2058	298	(12)	12	0	0,00
MEI	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	500	(4)	0	(4)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17/10/2057	200	(11)	11	0	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17/09/2058	596	(47)	47	0	0,00
MYC	Indice ABX.HE.AAA.6-2 Index	0,110	25/05/2046	523	(121)	116	(5)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	500	(4)	0	(4)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.6 Index	0,500	11/05/2063	1	0	0	0	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17/10/2057	100	(6)	6	0	0,00
SAL	Indice CMBX.NA.AAA.10 Index	0,500	17/11/2059	2 075	17	(22)	(5)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.11 Index	0,500	18/11/2054	1 200	6	(12)	(6)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.12 Index	0,500	17/08/2061	300	0	(2)	(2)	0,00
	Indice CMBX.NA.AAA.9 Index	0,500	17/09/2058	15 400	15	(20)	(5)	0,00
UAG	Indice CMBX.NA.AAA.8 Index	0,500	17/10/2057	100	(6)	6	0	0,00
					$ (665)	$ 567	$ (98)	(0,02)

[1] Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

[2] Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

Contrepartie	À payer/à recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel	Date d'échéance	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	À recevoir	Indice iBoxx USD Liquid High Yield Index	S/O	1,058 %	$ 200	20/06/2023	$ (2)	$ (2)	$ (4)	0,00

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£	107	$	129	$ 1	$ 0	$ 1	0,00
	01/2023	$	4 498	AUD	6 641	7	0	7	0,00
	01/2023		383	£	314	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023		121	KRW	157 953	5	0	5	0,00
	01/2023		257	PEN	987	1	0	1	0,00
	01/2023	ZAR	1 463	$	83	0	(3)	(3)	0,00
	02/2023	PEN	1 791		456	0	(12)	(12)	0,00
	02/2023	$	826	NOK	8 197	8	0	8	0,00
	02/2023	ZAR	1 301	$	73	0	(4)	(4)	0,00
	03/2023	TWD	7 920		269	9	0	9	0,00
	03/2023	$	583	IDR	9 094 800	5	0	5	0,00
	03/2023	ZAR	24 030	$	1 364	0	(40)	(40)	(0,01)
BOM	01/2023	$	1 154	CAD	1 549	0	(10)	(10)	0,00
BPS	01/2023	PEN	1 131	$	293	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	$	3 571	KRW	4 655 966	131	0	131	0,03
	01/2023		84	ZAR	1 463	2	0	2	0,00
	02/2023		385	IDR	6 057 720	6	0	6	0,00
	02/2023	ZAR	16 466	$	917	0	(47)	(47)	(0,01)
	03/2023	MXN	31 699		1 573	0	(31)	(31)	(0,01)
	03/2023	TWD	377		13	0	0	0	0,00
	03/2023	$	22	CLP	19 175	0	0	0	0,00
	03/2023		293	PEN	1 137	4	0	4	0,00
BRC	01/2023	CNH	2 513	$	360	0	(3)	(3)	0,00
CBK	01/2023	CLP	952 491		1 071	0	(46)	(46)	(0,01)
	01/2023	PEN	8 777		2 193	0	(103)	(103)	(0,02)
	01/2023	$	510	AUD	752	0	0	0	0,00
	01/2023		7 519	BRL	39 463	0	(44)	(44)	(0,01)
	01/2023		999	CLP	952 170	117	0	117	0,02
	01/2023		399	¥	53 100	3	0	3	0,00
	01/2023		4	PEN	17	0	0	0	0,00
	01/2023		143	ZAR	2 502	4	0	4	0,00
	02/2023	BRL	7 035	$	1 303	0	(22)	(22)	0,00
	02/2023	$	1 071	CLP	957 738	47	0	47	0,01

Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	02/2023	$	1 530	NZD	2 391	$ 0	$ (17)	$ (17)	0,00
	03/2023	MXN	562	$	28	0	(1)	(1)	0,00
	03/2023	$	124	CLP	107 456	1	0	1	0,00
	03/2023		825	PEN	3 250	22	0	22	0,00
	04/2023		356		1 424	14	0	14	0,00
	05/2023	MXN	197	$	10	0	0	0	0,00
DUB	02/2023	ZAR	1 716		103	2	0	2	0,00
GLM	01/2023	BRL	39 463		7 405	0	(70)	(70)	(0,01)
	01/2023	CNH	2 609		375	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	ZAR	1 329		74	0	(4)	(4)	0,00
	03/2023	MXN	716		36	0	0	0	0,00
	03/2023	$	3 103	MXN	63 783	125	0	125	0,03
	04/2023		7 275	BRL	39 463	71	0	71	0,01
	05/2023		1 234	PEN	4 932	46	0	46	0,01
	05/2023	ZAR	3 016	$	180	5	0	5	0,00
JPM	01/2023	£	8 043		9 712	36	0	36	0,01
	01/2023	$	15	CNY	102	0	0	0	0,00
	02/2023	NOK	70	$	7	0	0	0	0,00
	02/2023	TWD	11 144		367	3	0	3	0,00
	02/2023	$	664	IDR	10 463 026	13	0	13	0,00
	03/2023		26	CNY	183	0	0	0	0,00
	03/2023		281	IDR	4 396 522	3	0	3	0,00
MBC	01/2023	€	8 661	$	9 077	0	(171)	(171)	(0,03)
	01/2023	$	454	AUD	679	7	0	7	0,00
	01/2023		1 401	CAD	1 879	0	(14)	(14)	0,00
	01/2023		3 989	¥	543 158	131	0	131	0,03
	01/2023	ZAR	9 108	$	522	0	(13)	(13)	0,00
	03/2023	PEN	739		192	0	(1)	(1)	0,00
	03/2023	TWD	11 006		374	13	0	13	0,00
	03/2023	$	170	IDR	2 668 460	2	0	2	0,00
	05/2023		740	CNH	4 968	0	(15)	(15)	0,00
MYI	01/2023	€	173	$	184	0	0	0	0,00
	01/2023	$	852	AUD	1 268	9	0	9	0,00
	01/2023		3 236	¥	443 290	126	0	126	0,02
	02/2023	TWD	20 603	$	676	3	0	3	0,00
	02/2023	ZAR	20 600		1 155	0	(52)	(52)	(0,01)
	03/2023	MXN	4 575		228	0	(4)	(4)	0,00
	03/2023	TWD	10 042		341	12	0	12	0,00
	03/2023	$	240	IDR	3 759 827	3	0	3	0,00
RBC	01/2023	CAD	4 801	$	3 515	0	(29)	(29)	(0,01)
	01/2023	$	10	AUD	15	0	0	0	0,00
	01/2023	ZAR	793	$	45	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	MXN	42 952		2 166	0	(24)	(24)	0,00
	02/2023	$	1 253	NOK	12 499	18	0	18	0,00
	03/2023	MXN	9 883	$	494	0	(8)	(8)	0,00
	03/2023	$	4 845	MXN	96 901	65	0	65	0,01
SCX	01/2023		57	AUD	85	0	0	0	0,00
	01/2023		1 006	CAD	1 352	0	(9)	(9)	0,00
	01/2023		329	PEN	1 263	2	0	2	0,00
	02/2023		699	IDR	11 009 467	13	0	13	0,00
	03/2023		135	PEN	521	0	0	0	0,00
	04/2023	ZAR	4 787	$	260	0	(19)	(19)	0,00
	09/2023		9 141		521	0	(5)	(5)	0,00
SSB	03/2023	$	620	CLP	542 872	11	0	11	0,00
UAG	01/2023		452	£	365	0	(13)	(13)	0,00
	01/2023		232	ZAR	4 039	5	0	5	0,00
	01/2023	ZAR	16 500	$	921	0	(47)	(47)	(0,01)
	02/2023	$	1 029	IDR	16 339 752	27	0	27	0,01
	03/2023	ZAR	1 878	$	105	0	(5)	(5)	0,00
	09/2023		6 658		380	0	(4)	(4)	0,00
						$ 1 138	$ (902)	$ 236	0,05

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution II, T en EUR (couverte) de capitalisation et T en EUR (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	CHF	853	$	902	$ 0	$ (21)	$ (21)	0,00
	01/2023	MXN	2 485		127	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	SGD	1 258		916	0	(22)	(22)	0,00
	01/2023	$	51	€	49	1	0	1	0,00
	01/2023		342	¥	45 249	1	0	1	0,00
BPS	01/2023	€	2 780	$	2 967	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	SGD	92		67	0	(2)	(2)	0,00
BRC	01/2023	NOK	3 387		340	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	SEK	6 273		599	0	(3)	(3)	0,00
CBK	01/2023	CHF	7 090		7 506	0	(161)	(161)	(0,03)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	01/2023	CNY	108	$	15	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	€	13 848		14 753	0	(32)	(32)	(0,01)
	01/2023	IDR	8 016 219		509	0	(10)	(10)	0,00
	01/2023	INR	15 646		191	2	0	2	0,00
	01/2023	SEK	143		14	0	0	0	0,00
	01/2023	TWD	74 965		2 440	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	228	AUD	341	4	0	4	0,00
	01/2023		1 255	CNY	8 678	2	0	2	0,00
	01/2023		125 572	€	121 038	3 661	0	3 661	0,72
	01/2023		391	MXN	7 597	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	MXN	7 597	$	389	1	0	1	0,00
GLM	01/2023	BRL	3 425		623	0	(26)	(26)	(0,01)
	01/2023	MXN	5 111		264	2	0	2	0,00
	01/2023	MYR	1 764		375	0	(25)	(25)	0,00
	01/2023	$	994	BRL	5 265	3	0	3	0,00
	01/2023		399	MYR	1 764	1	0	1	0,00
	02/2023	BRL	5 265	$	988	0	(4)	(4)	0,00
	02/2023	MYR	1 764		400	0	(4)	(4)	0,00
JPM	01/2023	BRL	1 840		348	0	0	0	0,00
	01/2023	£	4 886		5 900	22	0	22	0,00
	01/2023	ZAR	7		0	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	AUD	131		88	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	CAD	2 207		1 645	16	0	16	0,00
	01/2023	DKK	2 137		299	0	(8)	(8)	0,00
	01/2023	€	1 301		1 388	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	£	218		266	3	0	3	0,00
	01/2023	ILS	695		203	6	0	6	0,00
	01/2023	¥	575 670		4 249	0	(117)	(117)	(0,02)
	01/2023	NOK	362		37	0	0	0	0,00
	01/2023	$	163 050	€	155 542	3 024	0	3 024	0,60
MYI	01/2023	AUD	4 162	$	2 795	0	(28)	(28)	(0,01)
	01/2023	¥	493 745		3 604	0	(140)	(140)	(0,03)
	01/2023	ZAR	5 282		310	0	0	0	0,00
RBC	01/2023	AUD	48		32	0	0	0	0,00
SCX	01/2023		279		188	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	CNY	11 518		1 614	0	(54)	(54)	(0,01)
	01/2023	$	143 511	€	137 879	3 702	0	3 702	0,72
SOG	01/2023	KRW	1 252 623	$	943	0	(53)	(53)	(0,01)
UAG	01/2023	HKD	21 272		2 722	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	IDR	6 188		0	0	0	0	0,00
	01/2023	SEK	400		38	0	0	0	0,00
	01/2023	$	2	KRW	3 023	0	0	0	0,00
						$ 10 451	$ (726)	$ 9 725	1,91

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	CHF	0	$	1	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	£	1		1	0	0	0	0,00
	01/2023	SGD	1		0	0	0	0	0,00
	01/2023	$	83	£	69	0	0	0	0,00
BSH	01/2023	NOK	0	$	0	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	AUD	0		0	0	0	0	0,00
	01/2023	BRL	3		1	0	0	0	0,00
	01/2023	CHF	4		4	0	0	0	0,00
	01/2023	CNY	0		0	0	0	0	0,00
	01/2023	€	1		1	0	0	0	0,00
	01/2023	IDR	4 755		0	0	0	0	0,00
	01/2023	ILS	0		0	0	0	0	0,00
	01/2023	INR	2		0	0	0	0	0,00
	01/2023	¥	324		2	0	0	0	0,00
	01/2023	MXN	4		0	0	0	0	0,00
	01/2023	NOK	2		0	0	0	0	0,00
	01/2023	TWD	43		1	0	0	0	0,00
	01/2023	$	1	BRL	3	0	0	0	0,00
	01/2023		1	CNY	5	0	0	0	0,00
	01/2023		0	MXN	4	0	0	0	0,00
	02/2023	BRL	3	$	1	0	0	0	0,00
	02/2023	MXN	4		0	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	AUD	2		1	0	0	0	0,00
	01/2023	DKK	1		0	0	0	0	0,00
	01/2023	¥	278		2	0	0	0	0,00
	01/2023	MYR	1		0	0	0	0	0,00
	01/2023	SEK	4		0	0	0	0	0,00
	01/2023	$	0	MYR	1	0	0	0	0,00
	01/2023	ZAR	3	$	0	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	AUD	0		0	0	0	0	0,00
	01/2023	CNY	6		1	0	0	0	0,00
	01/2023	€	4		4	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	8	£	7	0	0	0	0,00

Tableau des investissements Fonds Strategic Income Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
SOG	01/2023	HKD 12	$ 2	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	KRW 706	1	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 69	£ 58	0	0	0	0,00
TOR	01/2023	CAD 1	$ 1	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 80	£ 67	0	0	0	0,00
				$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						**$ 9 121**	**1,80**

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
2,000 % éch. 01/01/2053	$ 10 600	$ (8 628)	(1,70)
3,500 % éch. 01/01/2053	1 300	(1 181)	(0,23)
4,000 % éch. 01/01/2053 (j)	3 500	(3 283)	(0,65)
Total des Titres vendus à découvert		**$ (13 092)**	**(2,58)**
Total des Investissements		**$ 644 349**	**127,20**
Autres actifs et passifs à court terme		**$ (137 792)**	**(27,20)**
Actif net		**$ 506 557**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

µ La totalité ou une partie de ce montant représente des engagements de prêt non financés. Le taux d'intérêt pour la partie non financée sera déterminé au moment du financement.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à rémunération en nature.

(c) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(d) Titre à coupon zéro.

(e) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(f) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

(g) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(h) Affilié au Fonds.

(i) Titre convertible conditionnel.

(j) Les titres vendus à découvert au 31 décembre 2022 sont couverts par des positions longues sur des valeurs mobilières et des instruments du marché monétaire.

(k) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,39 %) :

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Intelsat Emergence S.A.	19/06/2017 - 23/02/2022	$ 5 147	$ 1 315	0,26
Morgan Stanley 0,000 % échéance 02/04/2032	11/02/2020	609	400	0,08
Neiman Marcus Group Ltd. LLC	25/09/2020	278	1 522	0,30
		$ 6 034	$ 3 237	0,64

Des titres d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 1 825 $) ont été nantis ou livrés en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 10 994 $ (31 décembre 2021 : 13 324 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 376 $ (31 décembre 2021 : 894 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 88 708	$ 512 322	$ 9 530	$ 610 560
Fonds d'investissement	29 661	0	0	29 661
Contrats de mise en pension	0	781	0	781
Instruments financiers dérivés[3]	840	15 599	0	16 439
Titres vendus à découvert	0	(13 092)	0	(13 092)
Totaux	**$ 119 209**	**$ 515 610**	**$ 9 530**	**$ 644 349**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 157 199	$ 591 957	$ 9 155	$ 758 311
Fonds d'investissement	15 171	0	0	15 171
Contrats de mise en pension	0	476	0	476
Instruments financiers dérivés[3]	(174)	263	0	89
Titres vendus à découvert	0	(32 833)	0	(32 833)
Totaux	**$ 172 196**	**$ 559 863**	**$ 9 155**	**$ 741 214**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ S/O	$ S/O	$ S/O	$ 13	$ 0	$ 13
BOA	(103)	0	(103)	37	(300)	(263)
BOM	(10)	0	(10)	S/O	S/O	S/O
BPS	12	0	12	(775)	630	(145)
BRC	(125)	0	(125)	(1)	0	(1)
CBK	3 416	(3 380)	36	183	(130)	53
DUB	(14)	0	(14)	9	0	9
FAR	(25)	0	(25)	S/O	S/O	S/O
FBF	S/O	S/O	S/O	13	0	13
GLM	(221)	81	(140)	(170)	260	90
GST	(156)	191	35	287	(340)	(53)
HUS	17	0	17	95	0	95
JPM	67	0	67	10	0	10
MBC	2 861	(2 480)	381	S/O	S/O	S/O
MEI	(4)	0	(4)	9	0	9
MYC	(63)	94	31	61	(76)	(15)
MYI	(71)	(96)	(167)	(26)	0	(26)
RBC	21	0	21	1 380	(900)	480
RYL	S/O	S/O	S/O	14	0	14
SAL	(26)	0	(26)	154	(260)	(106)
SCX	3 628	(3 470)	158	1 594	(1 000)	594
SOG	(53)	0	(53)	S/O	S/O	S/O
SSB	11	0	11	59	0	59
TOR	S/O	S/O	S/O	1 561	(1 000)	561
UAG	(41)	10	(31)	(13)	0	(13)

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	59,01	69,92
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	59,05	47,30
Autres valeurs mobilières	2,47	5,11
Fonds d'investissement	5,86	2,45
Contrats de mise en pension	0,15	0,08
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,10	0,01
Instruments financiers dérivés compensés	1,34	(0,72)
Instruments financiers dérivés hors cote	1,80	0,72
Titres vendus à découvert	(2,58)	(5,30)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	S/O	(0,30)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Crédits consortiaux et cessions	1,83	3,82
Obligations et billets privés	14,21	25,35
Obligations et billets convertibles	S/O	0,00
Obligations et billets municipaux	0,08	0,42
Agences du gouvernement américain	31,14	27,41
Obligations du Trésor américain	14,89	9,97
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	5,69	6,35

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Titres adossés à des actifs	16,75	15,46
Émissions souveraines	4,32	6,93
Actions ordinaires	24,18	25,12
Droits	0,02	S/O
Bons de souscription	0,01	0,01
Titres privilégiés	0,42	0,33
Sociétés d'investissement immobilier	5,31	0,99
Instruments à court terme	1,68	0,17
Fonds d'investissement	5,86	2,45
Contrats de mise en pension	0,15	0,08
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,10	0,01
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	0,00	S/O
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,01	0,03
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,21	0,05
Swaps de taux d'intérêt	1,12	(0,80)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Options sur titres	S/O	0,00
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Options de change	S/O	(0,01)
Swaptions de taux d'intérêt	(0,09)	(0,03)
Options sur titres	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,05)	0,02
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	(0,02)	0,07
Swaps de taux d'intérêt	S/O	0,02
Swaps de rendement total sur indices	0,00	0,00
Contrats de change à terme	0,05	(0,05)
Contrats de change à terme couverts	1,91	0,70
Titres vendus à découvert	(2,58)	(5,30)
Autres actifs et passifs à court terme	(27,20)	(19,57)
Actif net	100,00	100,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES			
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
BANQUE ET FINANCE			
AIB Group PLC			
2,250 % éch. 04/04/2028	€ 4 400	$ 4 198	0,10
2,875 % éch. 30/05/2031	8 800	8 443	0,20
7,583 % éch. 14/10/2026	$ 2 400	2 446	0,06
alstria office REIT-AG			
1,500 % éch. 23/06/2026	€ 6 000	5 050	0,12
Altarea S.C.A.			
1,875 % éch. 17/01/2028	8 500	7 060	0,17
American Tower Corp.			
3,375 % éch. 15/05/2024	$ 3 500	3 408	0,08
Assicurazioni Generali SpA			
2,429 % éch. 14/07/2031	€ 1 800	1 575	0,04
AvalonBay Communities, Inc.			
3,200 % éch. 15/01/2028	$ 4 100	3 755	0,09
Aviation Capital Group LLC			
4,125 % éch. 01/08/2025	9 080	8 480	0,20
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.			
6,000 % éch. 15/01/2026 (d)(f)	€ 15 000	15 298	0,37
Banco de Sabadell S.A.			
0,875 % éch. 16/06/2028	6 300	5 423	0,13
Bank of America Corp.			
1,197 % éch. 24/10/2026	$ 15 000	13 350	0,32
Bank of Ireland Group PLC			
0,375 % éch. 10/05/2027	€ 12 300	11 267	0,27
Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.			
0,250 % éch. 29/06/2028	500	444	0,01
5,203 % éch. 20/07/2023	$ 3 300	3 305	0,08
Barclays PLC			
1,700 % éch. 03/11/2026	£ 5 400	5 763	0,14
2,852 % éch. 07/05/2026	$ 2 400	2 232	0,05
BNP Paribas S.A.			
2,219 % éch. 09/06/2026	13 300	12 223	0,29
Boston Properties LP			
4,500 % éch. 01/12/2028	1 000	929	0,02
BPCE S.A.			
0,500 % éch. 14/01/2028	€ 4 100	3 745	0,09
CaixaBank S.A.			
0,750 % éch. 26/05/2028	2 100	1 887	0,05
Castellum AB			
0,750 % éch. 04/09/2026 (g)	9 700	8 046	0,19
2,125 % éch. 20/11/2023	4 500	4 614	0,11
CBRE Global Investors Open-Ended Fund S.C.A. SICAV-SIF Pan European Core Fund			
0,500 % éch. 27/01/2028	13 300	11 000	0,26
0,900 % éch. 12/10/2029	7 600	5 926	0,14
Citigroup, Inc.			
1,250 % éch. 06/07/2026	5 000	4 980	0,12
3,070 % éch. 24/02/2028	$ 7 400	6 682	0,16
Citycon Treasury BV			
1,625 % éch. 12/03/2028	€ 15 000	11 717	0,28
Clarion Funding PLC			
1,250 % éch. 13/11/2032	£ 2 400	1 997	0,05
Cooperatieve Rabobank UA			
4,655 % éch. 22/08/2028	$ 10 500	10 095	0,24
CPI Property Group S.A.			
1,750 % éch. 14/01/2030	€ 6 100	3 972	0,10
2,750 % éch. 12/05/2026	27 100	22 779	0,55
2,750 % éch. 22/01/2028	£ 400	322	0,01
Credit Suisse Group AG			
3,750 % éch. 26/03/2025	$ 3 070	2 765	0,07
3,869 % éch. 12/01/2029	12 000	9 636	0,23
5,975 % éch. 12/06/2024	13 200	12 503	0,30
6,442 % éch. 11/08/2028	5 650	5 154	0,12
6,537 % éch. 12/08/2033	13 000	11 439	0,28
7,000 % éch. 30/09/2027	£ 8 800	9 965	0,24
CTP NV			
0,500 % éch. 21/06/2025	€ 1 400	1 254	0,03
0,875 % éch. 20/01/2026	10 200	8 873	0,21
1,500 % éch. 27/09/2031	4 700	3 016	0,07
Deutsche Bank AG			
1,000 % éch. 19/11/2025	17 200	17 153	0,41
1,375 % éch. 10/06/2026	4 450	4 468	0,11
1,625 % éch. 20/01/2027	7 400	6 975	0,17
1,750 % éch. 19/11/2030	€ 14 200	$ 11 936	0,29
1,875 % éch. 23/02/2028	4 000	3 740	0,09
2,625 % éch. 16/12/2024	£ 9 000	10 067	0,24
2,625 % éch. 12/02/2026	€ 600	605	0,01
3,961 % éch. 26/11/2025	$ 6 800	6 503	0,16
Digital Dutch Finco BV			
0,625 % éch. 15/07/2025	€ 4 600	4 401	0,11
1,000 % éch. 15/01/2032	1 000	750	0,02
Digital Euro Finco LLC			
2,500 % éch. 16/01/2026	6 100	6 042	0,15
Digital Intrepid Holding BV			
0,625 % éch. 15/07/2031	10 300	7 565	0,18
Digital Realty Trust LP			
3,600 % éch. 01/07/2029	$ 2 900	2 596	0,06
EQT AB			
2,375 % éch. 06/04/2028	€ 10 000	9 398	0,23
2,875 % éch. 06/04/2032	7 400	6 406	0,15
Equinix, Inc.			
1,000 % éch. 15/09/2025	$ 8 600	7 699	0,19
Essex Portfolio LP			
3,375 % éch. 15/04/2026	700	659	0,02
Banque européenne d'investissement			
0,750 % éch. 15/11/2024	£ 9 700	10 960	0,26
Union européenne			
0,000 % éch. 04/10/2028 (a)	€ 1 678	1 510	0,04
Federal Realty Investment Trust			
3,250 % éch. 15/07/2027	$ 600	552	0,01
Fédération des Caisses Desjardins du Québec			
4,400 % éch. 23/08/2025	11 000	10 743	0,26
Ford Motor Credit Co. LLC			
1,744 % éch. 19/07/2024	€ 7 600	7 766	0,19
2,748 % éch. 14/06/2024	£ 4 600	5 244	0,13
G City Europe Ltd.			
4,250 % éch. 11/09/2025	€ 11 600	10 398	0,25
General Motors Financial Co., Inc.			
4,250 % éch. 15/05/2023	$ 4 900	4 880	0,12
Globalworth Real Estate Investments Ltd.			
2,950 % éch. 29/07/2026	€ 7 100	6 036	0,15
GLP Capital LP			
4,000 % éch. 15/01/2030	$ 2 600	2 282	0,05
5,300 % éch. 15/01/2029	2 000	1 896	0,05
Goldman Sachs Group, Inc.			
5,700 % éch. 01/11/2024	9 900	10 025	0,24
Goodman HK Finance			
4,375 % éch. 19/06/2024	5 045	4 934	0,12
Goodman U.S. Finance Four LLC			
4,500 % éch. 15/10/2037	6 900	5 804	0,14
GSPA Monetization Trust			
6,422 % éch. 09/10/2029	10 498	10 087	0,24
Host Hotels & Resorts LP			
4,500 % éch. 01/02/2026	7 800	7 483	0,18
Indian Railway Finance Corp. Ltd.			
3,835 % éch. 13/12/2027	3 300	3 068	0,07
ING Groep NV			
1,125 % éch. 07/12/2028	£ 9 100	8 777	0,21
2,125 % éch. 23/05/2026	€ 4 200	4 271	0,10
Association internationale de développement			
0,750 % éch. 21/09/2028	£ 11 000	10 864	0,26
1,750 % éch. 05/05/2037	€ 11 100	9 934	0,24
Intesa Sanpaolo SpA			
0,750 % éch. 16/03/2028	10 200	9 073	0,22
Jackson National Life Global Funding			
5,473 % éch. 28/06/2024	$ 8 600	8 604	0,21
JPMorgan Chase & Co.			
4,851 % éch. 25/07/2028	12 000	11 717	0,28
KBC Group NV			
0,250 % éch. 01/03/2027	€ 3 000	2 827	0,07
0,375 % éch. 16/06/2027	3 200	3 021	0,07
Kojamo Oyj			
0,875 % éch. 28/05/2029	500	398	0,01
1,875 % éch. 27/05/2027	2 700	2 438	0,06
Kookmin Bank			
4,500 % éch. 01/02/2029 (f)	$ 7 400	6 907	0,17
LeasePlan Corp. NV			
0,250 % éch. 23/02/2026	€ 15 000	13 937	0,34
Lendlease Finance Ltd.			
3,400 % éch. 27/10/2027	AUD 24 900	$ 14 739	0,36
3,700 % éch. 31/03/2031	4 800	2 494	0,06
Lloyds Banking Group PLC			
4,375 % éch. 22/03/2028	$ 1 200	1 141	0,03
Logicor Financing SARL			
1,625 % éch. 15/07/2027	€ 1 100	956	0,02
2,000 % éch. 17/01/2034	11 600	7 881	0,19
2,250 % éch. 13/05/2025	13 000	12 697	0,31
3,250 % éch. 13/11/2028	12 600	11 346	0,27
MassMutual Global Funding			
5,050 % éch. 07/12/2027	$ 7 100	7 147	0,17
Mid-America Apartments LP			
4,300 % éch. 15/10/2023	2 200	2 188	0,05
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			
0,978 % éch. 09/06/2024	€ 3 200	3 306	0,08
1,412 % éch. 17/07/2025	$ 11 200	10 181	0,25
Mizuho Financial Group, Inc.			
0,849 % éch. 08/09/2024	17 100	16 508	0,40
3,752 % éch. 19/07/2023	AUD 10 400	7 000	0,17
4,899 % éch. 10/07/2024	$ 8 600	8 581	0,21
5,414 % éch. 13/09/2028	10 000	10 019	0,24
MPT Operating Partnership LP			
2,550 % éch. 05/12/2023	£ 1 300	1 489	0,04
NatWest Group PLC			
0,750 % éch. 15/11/2025	€ 15 000	14 984	0,36
0,780 % éch. 26/02/2030	10 000	8 396	0,20
NE Property BV			
1,875 % éch. 09/10/2026	10 700	9 623	0,23
3,375 % éch. 14/07/2027	8 800	8 150	0,20
New Immo Holding S.A.			
2,750 % éch. 26/11/2026 (g)	8 800	8 001	0,19
Nissan Motor Acceptance Co. LLC			
3,875 % éch. 21/09/2023	$ 3 500	3 436	0,08
Nomura Holdings, Inc.			
2,679 % éch. 16/07/2030	7 300	5 854	0,14
NTT Finance Corp.			
4,239 % éch. 25/07/2025	2 700	2 654	0,06
OneMain Finance Corp.			
6,875 % éch. 15/03/2025	800	770	0,02
Park Aerospace Holdings Ltd.			
4,500 % éch. 15/03/2023	6 800	6 784	0,16
Piper Sandler Cos.			
5,200 % éch. 15/10/2023	8 500	8 425	0,20
Prologis Euro Finance LLC			
1,500 % éch. 08/02/2034	€ 1 200	963	0,02
Prologis International Funding S.A.			
1,625 % éch. 17/06/2032	1 000	812	0,02
3,125 % éch. 01/06/2031	10 000	9 507	0,23
Reliance Standard Life Global Funding			
3,850 % éch. 19/09/2023	$ 6 950	6 862	0,17
Sagax AB			
1,125 % éch. 30/01/2027	€ 11 700	10 114	0,24
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB			
1,000 % éch. 12/08/2027	8 100	6 045	0,15
1,125 % éch. 04/09/2026	12 600	10 026	0,24
Santander UK Group Holdings PLC			
2,421 % éch. 17/01/2029	£ 800	795	0,02
SBB Treasury Oyj			
1,125 % éch. 26/11/2029	€ 1 000	684	0,02
Société Générale S.A.			
1,488 % éch. 14/12/2026	$ 14 100	12 270	0,30
4,677 % éch. 15/06/2027	6 700	6 525	0,16
Standard Chartered PLC			
0,800 % éch. 17/11/2029	€ 3 600	3 058	0,07
1,456 % éch. 14/01/2027	$ 15 800	13 719	0,33
7,776 % éch. 16/11/2025	1 700	1 752	0,04
Starwood Property Trust, Inc.			
3,750 % éch. 31/12/2024	1 200	1 128	0,03
4,375 % éch. 15/01/2027	800	701	0,02
Stifel Financial Corp.			
4,000 % éch. 15/05/2030	12 900	11 217	0,27
Tesco Property Finance PLC			
5,744 % éch. 13/04/2040	£ 4 283	4 824	0,12
Toyota Motor Credit Corp.			
5,050 % éch. 11/12/2023	$ 5 500	5 509	0,13

Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
UBS AG				
5,125 % éch. 15/05/2024 (f)	$	21 200	$ 20 970	0,51
UBS Group AG				
5,125 % éch. 29/07/2026 (d)(f)		1 300	1 219	0,03
UniCredit SpA				
2,200 % éch. 22/07/2027	€	9 700	9 394	0,23
7,830 % éch. 04/12/2023	$	26 900	27 185	0,65
Volkswagen Bank GmbH				
1,875 % éch. 31/01/2024	€	7 500	7 846	0,19
Volkswagen Financial Services NV				
1,125 % éch. 18/09/2023	£	11 600	13 615	0,33
1,875 % éch. 03/12/2024		3 800	4 270	0,10
Vonovia SE				
1,375 % éch. 28/01/2026	€	9 900	9 600	0,23
2,375 % éch. 25/03/2032		2 100	1 789	0,04
Wells Fargo & Co.				
4,808 % éch. 25/07/2028	$	9 600	9 392	0,23
Workspace Group PLC				
2,250 % éch. 11/03/2028	£	7 600	6 818	0,16
Yorkshire Building Society				
3,511 % éch. 11/10/2030		2 400	2 439	0,06
			996 213	24,00
INDUSTRIE				
Amdocs Ltd.				
2,538 % éch. 15/06/2030	$	5 800	4 708	0,11
Arrow Electronics, Inc.				
4,500 % éch. 01/03/2023		7 300	7 285	0,17
Atlantia SpA				
1,875 % éch. 12/02/2028	€	26 700	23 758	0,57
Babcock International Group PLC				
1,375 % éch. 13/09/2027		8 300	7 399	0,18
Bacardi Ltd.				
4,450 % éch. 15/05/2025	$	13 000	12 626	0,30
Bayer U.S. Finance LLC				
5,779 % éch. 15/12/2023		8 000	7 984	0,19
Boardwalk Pipelines LP				
3,400 % éch. 15/02/2031		7 700	6 459	0,16
Boeing Co.				
1,167 % éch. 04/02/2023		8 800	8 767	0,21
2,750 % éch. 01/02/2026		6 400	5 938	0,14
Broadcom, Inc.				
4,150 % éch. 15/11/2030		2 173	1 953	0,05
4,300 % éch. 15/11/2032		4 800	4 244	0,10
Campbell Soup Co.				
4,150 % éch. 15/03/2028		1 600	1 531	0,04
Centene Corp.				
4,625 % éch. 15/12/2029		5 000	4 580	0,11
Chanel Ceres PLC				
0,500 % éch. 31/07/2026	€	10 400	10 004	0,24
Charter Communications Operating LLC				
4,908 % éch. 23/07/2025	$	17 900	17 561	0,42
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC				
5,125 % éch. 30/06/2027		8 700	8 609	0,21
Choice Hotels International, Inc.				
3,700 % éch. 01/12/2029		1 500	1 310	0,03
D.R. Horton, Inc.				
4,750 % éch. 15/02/2023		4 900	4 898	0,12
Dell International LLC				
5,450 % éch. 15/06/2023		4 587	4 590	0,11
Delta Air Lines Pass-Through Trust				
2,000 % éch. 10/12/2029		3 147	2 685	0,06
eBay, Inc.				
5,900 % éch. 22/11/2025		7 700	7 871	0,19
Emory University				
2,143 % éch. 01/09/2030		10 400	8 630	0,21
Energy Transfer LP				
4,500 % éch. 15/04/2024		5 300	5 227	0,13
Entergy Louisiana LLC				
2,350 % éch. 15/06/2032		14 000	11 164	0,27
Equifax, Inc.				
5,100 % éch. 15/12/2027		7 800	7 713	0,19
Expedia Group, Inc.				
3,800 % éch. 15/02/2028		3 790	3 486	0,08
Global Payments, Inc.				
4,950 % éch. 15/08/2027	$	7 300	$ 7 093	0,17
Global Switch Finance BV				
1,375 % éch. 07/10/2030	€	1 700	1 539	0,04
Gray Oak Pipeline LLC				
3,450 % éch. 15/10/2027	$	12 600	11 166	0,27
HCA, Inc.				
3,125 % éch. 15/03/2027		9 200	8 378	0,20
Hyundai Capital America				
1,000 % éch. 17/09/2024		9 350	8 644	0,21
Imperial Brands Finance PLC				
3,125 % éch. 26/07/2024		12 000	11 479	0,28
6,125 % éch. 27/07/2027		5 000	4 984	0,12
Informa PLC				
2,125 % éch. 06/10/2025	€	15 300	15 541	0,37
International Business Machines Corp.				
4,000 % éch. 27/07/2025	$	5 000	4 924	0,12
International Flavors & Fragrances, Inc.				
2,300 % éch. 01/11/2030		7 400	5 888	0,14
3,200 % éch. 01/05/2023		5 400	5 367	0,13
JSW Hydro Energy Ltd.				
4,125 % éch. 18/05/2031		2 390	1 995	0,05
Kansas City Southern				
3,125 % éch. 01/06/2026		7 050	6 630	0,16
Lendlease Europe Finance PLC				
3,500 % éch. 02/12/2033	£	7 300	5 645	0,14
Marks & Spencer PLC				
3,750 % éch. 19/05/2026		7 500	7 886	0,19
Motorola Solutions, Inc.				
2,300 % éch. 15/11/2030	$	12 400	9 724	0,23
NetApp, Inc.				
1,875 % éch. 22/06/2025		2 954	2 716	0,06
2,700 % éch. 22/06/2030		5 200	4 274	0,10
Netflix, Inc.				
4,625 % éch. 15/05/2029	€	700	736	0,02
Nissan Motor Co. Ltd.				
4,345 % éch. 17/09/2027	$	2 500	2 271	0,05
4,810 % éch. 17/09/2030		15 600	13 273	0,32
NXP BV				
3,875 % éch. 18/06/2026		9 900	9 417	0,23
Pearson Funding PLC				
3,750 % éch. 04/06/2030	£	4 500	4 794	0,12
Rexel S.A.				
2,125 % éch. 15/12/2028	€	14 200	13 204	0,32
Royalty Pharma PLC				
1,200 % éch. 02/09/2025	$	3 000	2 688	0,06
SEB S.A.				
1,375 % éch. 16/06/2025	€	5 000	4 965	0,12
Siemens Financieringsmaatschappij NV				
1,200 % éch. 11/03/2026	$	2 200	1 963	0,05
Sprint Spectrum Co. LLC				
4,738 % éch. 20/09/2029		1 645	1 627	0,04
Syngenta Finance NV				
3,375 % éch. 16/04/2026	€	7 000	7 063	0,17
Tesco Corporate Treasury Services PLC				
0,375 % éch. 27/07/2029		7 400	6 128	0,15
Thames Water Utilities Finance PLC				
0,875 % éch. 31/01/2028		2 100	1 911	0,05
Tornator Oyj				
1,250 % éch. 14/10/2026		5 600	5 361	0,13
United Airlines Pass-Through Trust				
2,875 % éch. 07/04/2030	$	3 237	2 760	0,07
Utah Acquisition Sub, Inc.				
3,950 % éch. 15/06/2026		6 500	6 085	0,15
Volkswagen Group of America Finance LLC				
4,750 % éch. 13/11/2028		3 000	2 914	0,07
			402 013	9,69
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
Avangrid, Inc.				
3,800 % éch. 01/06/2029		2 615	2 382	0,06
DTE Energy Co.				
1,050 % éch. 01/06/2025		2 600	2 357	0,06
Duke Energy Progress LLC				
3,375 % éch. 01/09/2023		100	99	0,00
Edison International				
3,550 % éch. 15/11/2024	$	8 060	$ 7 787	0,19
EDP Finance BV				
1,710 % éch. 24/01/2028		12 700	10 502	0,25
Enel Finance International NV				
0,375 % éch. 28/05/2029	€	3 400	2 889	0,07
0,875 % éch. 28/09/2034		9 800	7 044	0,17
1,125 % éch. 17/10/2034		11 000	8 276	0,20
2,875 % éch. 11/04/2029	£	10 000	10 314	0,25
Ipalco Enterprises, Inc.				
3,700 % éch. 01/09/2024	$	5 500	5 333	0,13
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
2,200 % éch. 02/12/2026	AUD	2 000	1 209	0,03
6,894 % éch. 15/06/2067	$	791	669	0,02
Pacific Gas & Electric Co.				
2,100 % éch. 01/08/2027		3 200	2 738	0,07
3,150 % éch. 01/01/2026		12 500	11 629	0,28
3,300 % éch. 15/03/2027 ^		2 800	2 495	0,06
3,300 % éch. 01/12/2027 ^		4 800	4 244	0,10
3,400 % éch. 15/08/2024 ^		5 700	5 473	0,13
3,500 % éch. 15/06/2025 ^		3 600	3 400	0,08
4,250 % éch. 01/08/2023		1 300	1 294	0,03
4,650 % éch. 01/08/2028		2 400	2 211	0,05
4,750 % éch. 15/02/2044 ^		1 700	1 307	0,03
5,450 % éch. 15/06/2027		4 000	3 951	0,10
San Diego Gas & Electric Co.				
3,600 % éch. 01/09/2023		100	99	0,00
Sprint LLC				
7,875 % éch. 15/09/2023		3 400	3 455	0,08
TDC Net A/S				
5,056 % éch. 31/05/2028	€	5 100	5 361	0,13
VTR Comunicaciones SpA				
5,125 % éch. 15/01/2028	$	798	497	0,01
WEC Energy Group, Inc.				
1,375 % éch. 15/10/2027		5 000	4 249	0,10
			111 264	2,68
Total des Obligations et billets privés			1 509 490	36,37
OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX				
Obligations Chicago, Illinois General Obligation Bonds, Series 2015				
7,750 % éch. 01/01/2042		901	916	0,02
Obligations Tobacco Settlement Finance Authority, West Virginia Revenue Bonds, Series 2020				
3,301 % éch. 01/06/2033		7 125	5 654	0,14
Billets University of California Revenue Notes, Series 2020				
0,883 % éch. 15/05/2025		5 500	5 047	0,12
			11 617	0,28
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Fannie Mae				
2,246 % éch. 01/03/2036		9	9	0,00
2,287 % éch. 01/04/2033		6	6	0,00
2,312 % éch. 01/12/2034		25	24	0,00
2,323 % éch. 01/03/2036		9	9	0,00
2,393 % éch. 01/01/2036		9	9	0,00
2,889 % éch. 01/10/2044		13	13	0,00
2,913 % éch. 01/09/2035		49	48	0,00
3,089 % éch. 01/10/2040		9	8	0,00
3,095 % éch. 01/07/2035		12	12	0,00
3,150 % éch. 01/08/2027		961	910	0,02
3,257 % éch. 25/05/2035		27	27	0,00
3,421 % éch. 01/07/2035		8	8	0,00
3,462 % éch. 01/05/2038		2 804	2 849	0,07
3,522 % éch. 01/11/2035		28	27	0,00
3,644 % éch. 25/12/2036		40	39	0,00
3,679 % éch. 01/05/2037		112	112	0,00
3,764 % éch. 01/06/2035		245	250	0,01
3,821 % éch. 25/07/2037		192	188	0,00
3,906 % éch. 01/09/2035		7	7	0,00
3,938 % éch. 01/09/2039		12	12	0,00
3,951 % éch. 01/09/2034		9	8	0,00
3,956 % éch. 01/09/2035		13	13	0,00
4,027 % éch. 01/11/2034		29	30	0,00
4,204 % éch. 01/11/2025		0	0	0,00
4,366 % éch. 25/09/2042		429	419	0,01
4,509 % éch. 25/03/2034		281	274	0,01
4,838 % éch. 01/09/2034		126	128	0,00
4,847 % éch. 25/12/2042		59	56	0,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
4,939 % éch. 25/09/2041	$ 1 541	$ 1 517	0,04
5,000 % éch. 25/04/2033 - 25/06/2043	160	158	0,00
5,289 % éch. 25/04/2032	11	11	0,00
5,900 % éch. 25/07/2042	34	35	0,00
Freddie Mac			
0,650 % éch. 22/10/2025	83 800	75 032	1,81
0,800 % éch. 28/10/2026	13 600	11 857	0,29
2,611 % éch. 15/03/2044	8 483	6 997	0,17
2,750 % éch. 15/09/2040	292	271	0,01
2,889 % éch. 25/02/2045	50	50	0,00
3,248 % éch. 25/10/2044	19	19	0,00
3,448 % éch. 25/07/2044	111	112	0,00
3,586 % éch. 01/09/2035	24	24	0,00
3,722 % éch. 01/09/2028	1	1	0,00
3,876 % éch. 01/07/2030	0	0	0,00
3,926 % éch. 01/07/2027	1	1	0,00
4,000 % éch. 01/10/2029 - 01/10/2047	877	842	0,02
4,051 % éch. 01/11/2035	44	43	0,00
4,059 % éch. 01/01/2028	1	1	0,00
4,500 % éch. 01/04/2029 - 01/07/2033	119	118	0,00
4,508 % éch. 15/10/2043	3 680	3 556	0,09
4,642 % éch. 25/10/2026	4 442	4 428	0,11
5,500 % éch. 01/06/2035 - 01/06/2039	1 968	2 040	0,05
6,000 % éch. 01/10/2027 - 01/05/2040	4 529	4 692	0,11
6,500 % éch. 15/09/2028	38	39	0,00
Ginnie Mae			
1,000 % éch. 20/01/2073	5 400	5 405	0,13
1,750 % éch. 20/12/2034	25	24	0,00
2,000 % éch. 20/10/2026	0	0	0,00
2,625 % éch. 20/07/2025 - 20/07/2034	66	65	0,00
2,863 % éch. 20/01/2066	9 368	9 229	0,22
2,875 % éch. 20/04/2030	5	5	0,00
3,000 % éch. 15/10/2049	996	885	0,02
3,379 % éch. 20/06/2067	3 118	3 104	0,08
3,613 % éch. 20/09/2065	1 327	1 316	0,03
4,344 % éch. 20/09/2065	9 063	8 917	0,22
4,362 % éch. 20/08/2062	940	933	0,02
4,407 % éch. 20/08/2065	5 651	5 564	0,13
4,442 % éch. 20/08/2065	4 165	4 100	0,10
4,576 % éch. 20/10/2072	8 198	8 182	0,20
4,646 % éch. 20/11/2067	6 078	6 058	0,15
4,770 % éch. 20/12/2072	5 100	5 114	0,12
4,966 % éch. 20/11/2072	9 918	10 018	0,24
5,000 % éch. 15/03/2034 - 15/07/2048	1 001	1 018	0,02
6,000 % éch. 20/09/2038	3	3	0,00
8,000 % éch. 20/05/2031	6	6	0,00
Ginnie Mae, TBA			
2,000 % éch. 01/02/2053	5 500	4 615	0,11
4,000 % éch. 01/01/2053	13 000	12 328	0,30
5,000 % éch. 01/01/2053	13 000	13 003	0,31
Administration des petites entreprises			
5,870 % éch. 01/07/2028	8	8	0,00
6,220 % éch. 01/12/2028	460	470	0,01
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)			
3,000 % éch. 01/03/2028 - 01/07/2052	163 599	143 814	3,47
3,500 % éch. 01/01/2047	132	123	0,00
4,000 % éch. 01/03/2023 - 01/04/2049	18 370	17 923	0,43
4,500 % éch. 01/04/2023 - 01/11/2041	817	813	0,02
5,000 % éch. 01/10/2031 - 01/04/2039	115	118	0,00
5,500 % éch. 01/06/2023 - 01/01/2040	3 110	3 192	0,08
6,000 % éch. 01/05/2024 - 01/02/2041	1 454	1 506	0,04
6,500 % éch. 01/07/2034 - 01/03/2037	68	71	0,00
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
3,000 % éch. 01/02/2053	398 288	349 942	8,42
3,500 % éch. 01/01/2053	280 030	254 605	6,13
4,000 % éch. 01/02/2053	363 000	340 651	8,21
4,500 % éch. 01/01/2038 - 01/02/2053	97 300	93 672	2,26
5,000 % éch. 01/01/2053	$ 128 300	$ 126 436	3,05
		1 550 575	37,34

OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN

Obligations du Trésor américain			
1,375 % éch. 15/11/2040	163 600	106 449	2,56
1,375 % éch. 15/08/2050	50 100	27 857	0,67
1,625 % éch. 15/11/2050	35 800	21 314	0,51
1,750 % éch. 15/08/2041	19 500	13 354	0,32
1,875 % éch. 15/02/2041	2 400	1 698	0,04
2,000 % éch. 15/02/2050	21 700	14 345	0,35
2,500 % éch. 15/02/2045	6 100	4 598	0,11
2,875 % éch. 15/08/2045	5 200	4 192	0,10
3,000 % éch. 15/05/2042	2 900	2 441	0,06
3,000 % éch. 15/11/2044	138 800	114 683	2,76
3,125 % éch. 15/11/2041	15 300	13 232	0,32
3,125 % éch. 15/02/2043	5 600	4 783	0,12
3,125 % éch. 15/08/2044	23 500	19 880	0,48
3,250 % éch. 15/05/2042	34 100	29 912	0,72
3,375 % éch. 15/08/2042	30 400	27 179	0,65
3,375 % éch. 15/05/2044	47 300	41 753	1,01
3,625 % éch. 15/02/2044	24 700	22 679	0,55
3,750 % éch. 15/08/2041	18 600	17 654	0,43
3,750 % éch. 15/11/2043	5 000	4 691	0,11
4,000 % éch. 15/11/2042 (h)	26 600	26 051	0,63
4,000 % éch. 15/11/2052	13 100	13 123	0,32
4,375 % éch. 15/11/2039	10 100	10 540	0,25
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation (c)			
0,125 % éch. 15/10/2024	17 885	17 226	0,41
0,125 % éch. 15/07/2031	17 677	15 632	0,38
0,125 % éch. 15/01/2032	13 652	11 968	0,29
0,125 % éch. 15/02/2051	3 548	2 288	0,06
0,250 % éch. 15/02/2050	7 186	4 853	0,12
0,500 % éch. 15/04/2024	8 507	8 273	0,20
0,625 % éch. 15/01/2024	30 649	30 001	0,72
0,625 % éch. 15/07/2032	15 999	14 667	0,35
0,625 % éch. 15/02/2043	130	105	0,00
0,750 % éch. 15/02/2045	6 074	4 918	0,12
1,000 % éch. 15/02/2049	2 605	2 180	0,05
1,375 % éch. 15/02/2044	384	356	0,01
Billets du Trésor américain			
1,750 % éch. 30/06/2024	16 700	16 006	0,39
1,875 % éch. 28/02/2027	16 700	15 297	0,37
2,875 % éch. 15/05/2032	25 000	23 047	0,55
		709 225	17,09

TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX

American Home Mortgage Investment Trust			
4,749 % éch. 25/12/2046	129	105	0,00
Angel Oak Mortgage Trust			
1,469 % éch. 25/06/2065	1 176	1 055	0,03
Ashford Hospitality Trust			
5,318 % éch. 15/06/2035	11 700	11 281	0,27
Atrium Hotel Portfolio Trust			
5,268 % éch. 15/06/2035	6 900	6 667	0,16
Banc of America Funding Trust			
3,418 % éch. 25/05/2035	1 414	1 333	0,03
3,635 % éch. 20/09/2035 ^	863	687	0,02
Banc of America Merrill Linch Trust			
3,218 % éch. 14/04/2033	5 500	5 101	0,12
Banc of America Mortgage Trust			
3,679 % éch. 25/07/2034	179	164	0,00
3,942 % éch. 25/07/2035 ^	214	194	0,01
BankUnited Trust			
4,989 % éch. 25/09/2045	835	743	0,02
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust			
4,314 % éch. 15/12/2051	8 000	7 629	0,18
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust			
2,780 % éch. 25/11/2030	2	2	0,00
3,027 % éch. 25/04/2034	203	169	0,00
3,086 % éch. 25/04/2034	91	84	0,00
3,213 % éch. 25/04/2034	178	164	0,00
3,239 % éch. 25/04/2033	13	13	0,00
3,844 % éch. 25/07/2034	6	5	0,00
3,976 % éch. 25/12/2035	104	100	0,00
4,010 % éch. 25/01/2034	155	150	0,00
4,089 % éch. 25/02/2034	64	59	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust			
3,115 % éch. 25/05/2035	397	369	0,01
3,729 % éch. 25/09/2035 ^	$ 429	$ 266	0,01
4,709 % éch. 25/02/2034	46	40	0,00
Citigroup Commercial Mortgage Trust			
3,251 % éch. 10/05/2035	8 300	7 782	0,19
Citigroup Mortgage Loan Trust			
3,871 % éch. 25/09/2037 ^	99	85	0,00
5,410 % éch. 25/10/2035	36	33	0,00
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.			
6,080 % éch. 25/09/2035	996	972	0,02
Commercial Mortgage Trust			
3,144 % éch. 10/03/2048	4 373	4 274	0,10
3,545 % éch. 10/02/2036	11 300	10 346	0,25
3,590 % éch. 10/11/2047	12 200	11 770	0,28
Countrywide Alternative Loan Trust			
4,839 % éch. 25/08/2037	9 582	3 033	0,07
5,500 % éch. 25/02/2036	3 090	2 445	0,06
5,500 % éch. 25/05/2036 ^	1 963	1 621	0,04
5,750 % éch. 25/02/2037	3 351	1 882	0,05
5,849 % éch. 25/11/2035	7 114	6 334	0,15
6,000 % éch. 25/02/2036	4 808	3 063	0,07
6,000 % éch. 25/04/2036 ^	196	97	0,00
6,000 % éch. 25/08/2036 ^	5 274	3 241	0,08
6,000 % éch. 25/08/2036	871	812	0,02
6,000 % éch. 25/11/2036 ^	263	154	0,00
6,000 % éch. 25/08/2037 ^	3 944	2 428	0,06
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
2,125 % éch. 19/07/2031	0	0	0,00
3,581 % éch. 20/10/2035	1 559	1 462	0,04
3,671 % éch. 20/02/2035	96	95	0,00
3,792 % éch. 25/11/2034	393	355	0,01
4,789 % éch. 25/04/2046	908	833	0,02
5,910 % éch. 20/02/2036 ^	52	44	0,00
6,000 % éch. 25/07/2037 ^	251	123	0,00
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust			
4,310 % éch. 25/01/2034 ^	16	12	0,00
4,729 % éch. 25/06/2035	130	123	0,00
6,500 % éch. 25/11/2034 ^	26	24	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp.			
3,187 % éch. 25/06/2033	3	3	0,00
Credit Suisse First Boston Mortgage-Backed Pass-Through Certificates			
6,000 % éch. 25/11/2035 ^	2 324	695	0,02
Credit Suisse Mortgage Capital Certificates			
2,746 % éch. 26/04/2038	780	753	0,02
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust			
5,750 % éch. 25/04/2036 ^	762	423	0,01
6,000 % éch. 25/05/2036 ^	1 871	1 103	0,03
6,000 % éch. 25/04/2037 ^	563	222	0,01
Deutsche ALT-A Securities Mortgage Loan Trust			
4,719 % éch. 25/08/2037 ^	2 651	2 245	0,05
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust			
3,728 % éch. 19/07/2044	10	9	0,00
Eurohome UK Mortgages PLC			
3,946 % éch. 15/06/2044	£ 2 151	2 469	0,06
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust			
4,010 % éch. 25/10/2034	$ 86	85	0,00
6,000 % éch. 25/06/2037	1 141	475	0,01
FirstMac Mortgage Funding Trust			
5,021 % éch. 08/03/2049	52	52	0,00
GS Mortgage Securities Corp. Trust			
5,238 % éch. 15/07/2025	3 810	3 714	0,09
GSR Mortgage Loan Trust			
3,028 % éch. 25/06/2034	54	52	0,00
3,154 % éch. 25/06/2034	23	21	0,00
3,767 % éch. 25/09/2035	1 640	1 541	0,04
3,796 % éch. 25/01/2036 ^	1 318	1 268	0,03
5,500 % éch. 25/01/2037 ^	11	22	0,00
HarborView Mortgage Loan Trust			
4,599 % éch. 19/03/2037	3 309	2 922	0,07
4,779 % éch. 19/05/2035	160	143	0,00
IndyMac Adjustable Rate Mortgage Trust			
3,544 % éch. 25/01/2032	0	0	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust			
4,869 % éch. 25/06/2037	1 038	904	0,02
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust			
3,358 % éch. 15/11/2048	11 593	11 216	0,27

Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust				
2,994 % éch. 15/12/2049	$	9 539	$ 9 082	0,22
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				
5,528 % éch. 15/06/2035		10 951	10 014	0,24
JPMorgan Mortgage Trust				
3,346 % éch. 25/07/2035		129	119	0,00
5,750 % éch. 25/01/2036 ^		336	167	0,00
Landmark Mortgage Securities PLC				
3,668 % éch. 17/04/2044	£	7 253	8 186	0,20
Lehman XS Trust				
4,749 % éch. 25/12/2036	$	4 040	3 793	0,09
4,789 % éch. 25/03/2047		11 141	9 144	0,22
London Wall Mortgage Capital PLC				
4,040 % éch. 15/05/2052	£	1 481	1 723	0,04
MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust				
3,565 % éch. 25/01/2036	$	11	10	0,00
3,874 % éch. 21/11/2034		1 779	1 604	0,04
MASTR Reperforming Loan Trust				
7,000 % éch. 25/05/2035		563	404	0,01
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
3,046 % éch. 25/02/2035		718	672	0,02
3,484 % éch. 25/06/2035		352	325	0,01
4,385 % éch. 25/11/2035		274	257	0,01
Metlife Securitization Trust				
3,750 % éch. 25/03/2057		6 665	6 289	0,15
Mortgage Equity Conversion Asset Trust				
5,140 % éch. 25/05/2042		4 524	3 948	0,10
MortgageIT Trust				
4,949 % éch. 25/10/2035		736	685	0,02
NAAC Reperforming Loan REMIC Trust				
7,000 % éch. 25/10/2034 ^		476	418	0,01
7,500 % éch. 25/03/2034 ^		612	532	0,01
NAAC Reperforming Loan REMIC Trust Certificates				
6,500 % éch. 25/02/2035 ^		2 020	1 786	0,04
New Residential Mortgage Loan Trust				
3,500 % éch. 25/12/2057		6 111	5 787	0,14
Nomura Asset Acceptance Corp. Alternative Loan Trust				
5,459 % éch. 25/02/2035		448	438	0,01
Paragon Mortgages PLC				
2,002 % éch. 15/11/2038	€	639	651	0,02
Pepper Residential Securities Trust				
4,210 % éch. 16/09/2059	AUD	7 041	4 753	0,11
Precise Mortgage Funding PLC				
0,000 % éch. 12/12/2055 (a)	£	0	4 055	0,10
Prime Mortgage Trust				
4,789 % éch. 25/02/2034	$	75	74	0,00
Primrose Residential DAC				
2,644 % éch. 24/03/2061	€	13 465	14 035	0,34
Residential Accredit Loans, Inc. Trust				
4,789 % éch. 25/05/2037 ^	$	2 476	1 811	0,04
6,000 % éch. 25/04/2036		2 672	2 067	0,05
Residential Asset Securitization Trust				
6,000 % éch. 25/01/2037 ^		2 510	933	0,02
6,500 % éch. 25/09/2036 ^		705	273	0,01
Residential Funding Mortgage Securities, Inc. Trust				
5,289 % éch. 25/02/2036 ^		129	107	0,00
RESIMAC Bastille Trust				
5,022 % éch. 05/12/2059		384	384	0,01
Resloc UK PLC				
3,682 % éch. 15/12/2043	£	3 864	4 439	0,11
Ripon Mortgages PLC				
4,011 % éch. 28/08/2056		15 156	17 893	0,43
RMAC Securities PLC				
3,936 % éch. 12/06/2044		812	889	0,02
Stratton Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2060		16 993	20 267	0,49
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
2,758 % éch. 25/02/2036 ^	$	1 394	1 260	0,03
3,980 % éch. 25/09/2034		257	246	0,01
4,001 % éch. 25/04/2034		1 647	1 606	0,04
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
4,609 % éch. 25/09/2047		10 994	8 900	0,21
4,819 % éch. 19/04/2035		283	255	0,01
4,839 % éch. 19/07/2035		209	194	0,01
4,919 % éch. 19/05/2034		174	162	0,00
4,949 % éch. 25/02/2036 ^		454	351	0,01
4,999 % éch. 19/09/2032	$	24	$ 23	0,00
5,239 % éch. 25/05/2047		7 626	6 020	0,15
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
7,500 % éch. 25/10/2036 ^		667	388	0,01
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Pass-Through Certificates				
5,041 % éch. 25/06/2033		3	3	0,00
Thornburg Mortgage Securities Trust				
3,010 % éch. 25/09/2037		2 727	2 624	0,06
6,666 % éch. 25/06/2047 ^		2 000	1 645	0,04
Towd Point Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2045	£	21 359	25 419	0,61
4,071 % éch. 20/10/2051		12 166	14 549	0,35
Tower Bridge Funding PLC				
4,051 % éch. 20/11/2063		7 642	9 017	0,22
Trinity Square PLC				
3,729 % éch. 15/07/2059		11 881	14 126	0,34
Tudor Rose Mortgages				
4,031 % éch. 20/06/2048		641	761	0,02
Twin Bridges PLC				
4,637 % éch. 12/12/2054		3 014	3 610	0,09
Uropa Securities PLC				
3,116 % éch. 10/10/2040		595	682	0,02
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,104 % éch. 25/09/2036 ^	$	1 077	935	0,02
3,217 % éch. 25/01/2037 ^		4 039	3 498	0,08
3,290 % éch. 25/02/2037 ^		675	610	0,02
4,929 % éch. 25/07/2045		326	301	0,01
4,969 % éch. 25/10/2045		3 370	3 117	0,08
5,009 % éch. 25/01/2045		141	135	0,00
5,029 % éch. 25/01/2045		1 694	1 571	0,04
Warwick Finance Residential Mortgages PLC				
0,000 % éch. 21/12/2049 (a)	£	0	1 589	0,04
4,387 % éch. 21/12/2049		10 556	12 698	0,31
5,087 % éch. 21/12/2049		2 030	2 442	0,06
5,587 % éch. 21/12/2049		1 015	1 221	0,03
6,087 % éch. 21/12/2049		580	698	0,02
6,587 % éch. 21/12/2049		580	698	0,02
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
4,466 % éch. 25/05/2035 ^	$	586	499	0,01
6,000 % éch. 25/11/2035 ^		513	406	0,01
Washington Mutual MSC Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
1,770 % éch. 25/02/2031		1	1	0,00
			390 434	9,41
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Accredited Mortgage Loan Trust				
0,924 % éch. 25/04/2036		231	230	0,01
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
4,509 % éch. 25/10/2036		235	93	0,00
4,549 % éch. 25/08/2036 ^		6 304	1 687	0,04
Ameriquest Mortgage Securities Trust				
4,974 % éch. 25/03/2036		295	293	0,01
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates				
5,094 % éch. 25/01/2036		2 165	2 154	0,05
5,319 % éch. 25/05/2035		4 518	4 414	0,11
5,409 % éch. 25/10/2034		1 511	1 485	0,04
5,499 % éch. 25/03/2035		4 705	4 578	0,11
Armada Euro CLO DAC				
2,098 % éch. 15/07/2031	€	12 000	12 441	0,30
Asset-Backed Funding Certificates Trust				
5,089 % éch. 25/06/2034	$	96	90	0,00
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust				
3,658 % éch. 25/12/2036		2 439	2 351	0,06
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				
5,229 % éch. 16/01/2030		14 285	14 133	0,34
Avoca CLO DAC				
2,068 % éch. 15/07/2030	€	13 686	14 302	0,34
2,198 % éch. 15/10/2032		5 200	5 373	0,13
Barings CLO Ltd.				
5,029 % éch. 15/04/2031	$	13 100	12 848	0,31
5,043 % éch. 20/01/2028		9 020	8 981	0,22
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
4,616 % éch. 25/02/2036		0	0	0,00
4,796 % éch. 25/05/2035	$	157	$ 155	0,00
5,034 % éch. 25/12/2035		1 283	1 278	0,03
5,389 % éch. 25/10/2037		20	20	0,00
5,589 % éch. 25/01/2045		200	197	0,00
Black Diamond CLO DAC				
2,778 % éch. 15/05/2032	€	12 000	12 417	0,30
Blackrock European CLO DAC				
1,998 % éch. 15/10/2031		13 000	13 453	0,32
BlueMountain CLO Ltd.				
5,505 % éch. 22/10/2030	$	1 078	1 064	0,03
BlueMountain Fuji EUR CLO DAC				
2,028 % éch. 15/07/2030	€	2 152	2 244	0,05
BNPP AM Euro CLO DAC				
2,322 % éch. 22/07/2032		12 000	12 410	0,30
Bosphorus CLO DAC				
2,866 % éch. 15/12/2030		290	301	0,01
Bridgepoint CLO DAC				
2,588 % éch. 15/01/2034		1 000	1 044	0,03
Cairn CLO DAC				
2,178 % éch. 30/04/2031		12 828	13 354	0,32
2,688 % éch. 20/10/2028		652	682	0,02
Carlyle Euro CLO DAC				
2,428 % éch. 15/08/2030		9 715	10 120	0,24
Carrington Mortgage Loan Trust				
5,379 % éch. 25/06/2035	$	919	886	0,02
CIFC Funding Ltd.				
5,259 % éch. 16/11/2030		1 400	1 387	0,03
CIT Mortgage Loan Trust				
5,739 % éch. 25/10/2037		1 545	1 537	0,04
Citigroup Mortgage Loan Trust				
4,709 % éch. 25/09/2036		4 642	3 338	0,08
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc.				
4,639 % éch. 25/03/2037		1 897	1 568	0,04
Commonbond Student Loan Trust				
5,239 % éch. 25/05/2041		681	671	0,02
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,529 % éch. 25/06/2047 ^		1 736	1 539	0,04
4,609 % éch. 25/09/2037 ^		1 223	1 255	0,03
4,619 % éch. 25/07/2037 ^		1 000	831	0,02
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust, Inc.				
5,244 % éch. 25/08/2034		201	197	0,00
5,289 % éch. 25/10/2034		890	843	0,02
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC				
4,354 % éch. 25/05/2046		1 785	1 484	0,04
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust				
4,509 % éch. 25/11/2036		119	57	0,00
CVC Cordatus Loan Fund DAC				
2,676 % éch. 15/09/2031	€	13 000	13 502	0,33
FBR Securitization Trust				
5,094 % éch. 25/11/2035	$	5 195	5 035	0,12
First Franklin Mortgage Loan Trust				
4,499 % éch. 25/12/2037		4 378	4 075	0,10
5,064 % éch. 25/03/2034		382	372	0,01
5,319 % éch. 25/07/2034		148	147	0,00
5,664 % éch. 25/07/2034		702	680	0,02
GE-WMC Mortgage Securities Trust				
4,469 % éch. 25/08/2036		34	15	0,00
Griffith Park CLO DAC				
2,522 % éch. 21/11/2031	€	12 000	12 398	0,30
Grosvenor Place CLO BV				
2,325 % éch. 30/10/2029		1 797	1 897	0,05
GSAMP Trust				
4,529 % éch. 25/12/2036	$	12 310	6 672	0,16
4,629 % éch. 25/01/2037		428	260	0,01
Harvest CLO DAC				
2,228 % éch. 15/01/2032	€	13 700	14 167	0,34
2,433 % éch. 18/11/2029		351	370	0,01
Home Equity Asset Trust				
4,989 % éch. 25/07/2036	$	6 128	5 450	0,13
5,424 % éch. 25/08/2035		147	143	0,00
HSI Asset Securitization Corp. Trust				
4,929 % éch. 25/12/2035		2 107	2 084	0,05
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
4,824 % éch. 25/05/2036		4 000	3 801	0,09
Jubilee CLO DAC				
1,988 % éch. 15/04/2030	€	20 000	20 866	0,50

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
LCM LP				
5,283 % éch. 20/10/2027	$	1 817	$ 1 809	0,04
Madison Park Euro Funding DAC				
2,128 % éch. 15/01/2032	€	12 300	12 710	0,31
Man GLG Euro CLO DAC				
2,736 % éch. 15/12/2031		11 100	11 493	0,28
Massachusetts Educational Financing Authority				
5,308 % éch. 25/04/2038	$	6	6	0,00
Merrill Lynch First Franklin Mortgage Loan Trust				
5,639 % éch. 25/10/2037		9 587	8 209	0,20
MF1 LLC				
6,471 % éch. 19/06/2037		11 300	11 140	0,27
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
4,569 % éch. 25/05/2037		568	498	0,01
4,589 % éch. 25/09/2036		961	368	0,01
4,619 % éch. 25/11/2036		969	586	0,01
4,689 % éch. 25/07/2036		7 838	3 195	0,08
4,709 % éch. 25/09/2036		7 808	3 531	0,09
5,094 % éch. 25/01/2035		1 476	1 364	0,03
5,364 % éch. 25/04/2035		71	71	0,00
Mountain View CLO Ltd.				
4,761 % éch. 13/10/2027		2 235	2 238	0,05
New Century Home Equity Loan Trust				
4,749 % éch. 25/05/2036		56	55	0,00
5,109 % éch. 25/10/2035		4 268	4 133	0,10
OZLM Ltd.				
5,159 % éch. 17/04/2031		10 246	10 021	0,24
5,665 % éch. 30/10/2030		10 881	10 726	0,26
Palmer Square European Loan Funding DAC				
2,098 % éch. 15/10/2031	€	11 442	11 841	0,29
Palmerston Park CLO DAC				
2,053 % éch. 18/04/2030		6 690	7 017	0,17
Park Place Securities, Inc.				
5,094 % éch. 25/09/2035	$	179	185	0,00
Purple Finance CLO DAC				
2,343 % éch. 25/01/2031	€	1 114	1 163	0,03
Renaissance Home Equity Loan Trust				
5,589 % éch. 25/11/2034	$	155	135	0,00
Residential Asset Securities Corp. Trust				
5,069 % éch. 25/11/2035		38	38	0,00
Securitized Asset-Backed Receivables LLC Trust				
4,629 % éch. 25/11/2036		5 966	1 791	0,04
4,669 % éch. 25/05/2036		448	244	0,01
Starwood Commercial Mortgage Trust				
5,520 % éch. 15/07/2038		7 836	7 681	0,18
Structured Asset Investment Loan Trust				
4,769 % éch. 25/03/2036		635	618	0,01
5,154 % éch. 25/08/2035		520	492	0,01
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust				
4,544 % éch. 25/09/2036		7 383	4 667	0,11
Venture CLO Ltd.				
5,343 % éch. 20/01/2029	$	18 554	$ 18 339	0,44
WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Trust				
4,749 % éch. 25/04/2037		5 020	1 953	0,05
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
5,389 % éch. 25/10/2034		1 054	1 021	0,02
			401 057	9,66

ÉMISSIONS SOUVERAINES

Action Logement Services				
0,500 % éch. 30/10/2034	€	7 600	5 660	0,14
Obligation internationale du gouvernement canadien				
2,250 % éch. 01/12/2029	CAD	38 600	26 734	0,64
Development Bank of Japan, Inc.				
0,010 % éch. 15/10/2024	€	6 600	6 625	0,16
0,875 % éch. 10/10/2025		4 300	4 281	0,10
Obligation internationale du gouvernement hongrois				
1,750 % éch. 05/06/2035		10 000	7 026	0,17
Obligation internationale du gouvernement israélien				
3,875 % éch. 03/07/2050	$	1 000	845	0,02
4,125 % éch. 17/01/2048		1 000	879	0,02
Japan Finance Organization for Municipalities				
0,010 % éch. 02/02/2028	€	9 900	8 892	0,21
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap				
0,875 % éch. 21/03/2046		10 000	6 095	0,15
Obligation internationale du gouvernement paraguayen				
4,950 % éch. 28/04/2031	$	2 300	2 231	0,05
Obligation internationale du gouvernement péruvien				
5,940 % éch. 12/02/2029	PEN	4 000	963	0,02
6,350 % éch. 12/08/2028		46 400	11 578	0,28
8,200 % éch. 12/08/2026		12 900	3 543	0,09
Province de l'Ontario				
1,850 % éch. 01/02/2027	CAD	7 000	4 779	0,12
Obligation internationale du gouvernement roumain				
3,000 % éch. 27/02/2027	$	12 000	10 671	0,26
Bon du Trésor britannique				
0,875 % éch. 31/07/2033	£	1 300	1 168	0,03
			101 970	2,46

INSTRUMENTS À COURT TERME

BILLETS DE TRÉSORERIE

CNH Industrial Capital LLC				
4,950 % éch. 21/02/2023	$	5 200	5 162	0,12
Crown Castle International Corp.				
5,000 % éch. 04/01/2023		6 000	5 996	0,14
Fiserv, Inc.				
4,630 % éch. 09/01/2023		8 100	8 090	0,20
National Grid Holdings Ltd.				
4,810 % éch. 24/01/2023	$	6 500	$ 6 479	0,16
Quanta Services, Inc.				
5,100 % éch. 09/01/2023		6 400	6 391	0,15
Republic Services, Inc.				
4,650 % éch. 12/01/2023		8 300	8 286	0,20
			40 404	0,97

BONS DU TRÉSOR HONGROIS

18,250 % éch. 03/01/2023 (a)(b)	HUF	2 092 000	5 576	0,14

BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN

0,886 % éch. 03/05/2023 (a)(b)	ILS	24 000	6 722	0,16
0,889 % éch. 03/05/2023 (a)(b)		17 820	4 991	0,12
1,181 % éch. 02/03/2023 (a)(b)		35 600	10 030	0,24
1,203 % éch. 02/03/2023 (a)(b)		7 400	2 085	0,05
			23 828	0,57

BONS DU TRÉSOR JAPONAIS

(0,120) % éch. 27/02/2023 (a)(b)	¥	3 520 000	26 685	0,64
Total des Instruments à court terme			96 493	2,32
Total des Valeurs mobilières			**$ 4 770 861**	**114,93**

	ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds US Short-Term Fund (e)	9 400 658	93 819	2,26
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	19 952 031	198 602	4,79
Total des Fonds d'investissement		**$ 292 421**	**7,05**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BOS	4,190 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 26 100	Obligations du Trésor américain 2,875 % échéance 15/05/2049	$ (26 800)	$ 26 100	$ 26 112	0,63
FICC	1,900	30/12/2022	03/01/2023	5 795	Billets du Trésor américain 0,125 % échéance 15/05/2023	(5 911)	5 795	5 796	0,14
	4,280	30/12/2022	03/01/2023	139 000	Billets du Trésor américain 0,250 % échéance 31/10/2025	(141 780)	139 000	139 066	3,35
Total des Contrats de mise en pension						**$ (174 491)**	**$ 170 895**	**$ 170 974**	**4,12**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	71	$ 57	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Court	03/2023	1 494	5 783	0,14
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	Court	03/2023	695	6 007	0,14

Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	1 745	$ 15 686	0,38
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	Court	03/2023	107	2 781	0,07
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars	Court	03/2023	643	6 492	0,16
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Court	03/2023	137	2 774	0,07
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	71	(363)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Long	03/2023	660	89	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Long	03/2023	2 010	(406)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	2 853	(2 657)	(0,06)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Long	03/2023	148	(168)	(0,01)
				$ 36 075	0,87

[1] Option de style contrat à terme standardisé.

OPTIONS VENDUES

OPTIONS SUR CONTRATS À TERME STANDARDISÉS NÉGOCIÉS EN BOURSE

Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Nbre de Contrats	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
Option d'achat - Exercice d'une Option d'achat CME à 98,000 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	$ 98,000	15/12/2023	70	$ (57)	$ (6)	0,00
Option de vente - Exercice d'une Option de vente CME à 96,500 USD sur Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	96,500	15/12/2023	70	(65)	(212)	(0,01)
				$ (122)	$ (218)	(0,01)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé					**$ 35 857**	**0,86**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - ACHAT DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Verizon Communications, Inc.	(1,000) %	20/06/2027	$ 5 200	$ (23)	0,00

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[2]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
AT&T, Inc.	1,000 %	20/06/2023	$ 6 400	$ 12	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2023	7 300	(81)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2024	12 400	21	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20/12/2023	€ 3 900	7	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2025	$ 4 600	48	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2027	4 600	126	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2023	8 300	447	0,01
General Electric Co.	1,000	20/06/2024	4 700	41	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2024	5 500	129	0,01
Rolls-Royce PLC	1,000	20/06/2025	€ 14 500	2 067	0,05
Ryder System, Inc.	1,000	20/12/2023	$ 1 500	31	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2027	6 700	40	0,00
				$ 2 888	0,07

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[3]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.HY-35 à 5 ans	(5,000) %	20/12/2025	$ 9 504	$ 412	0,01
Indice CDX.HY-36 à 5 ans	(5,000)	20/06/2026	5 346	347	0,01
Indice CDX.HY-38 à 5 ans	(5,000)	20/06/2027	98 109	(4 620)	(0,11)
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	(1,000)	20/12/2027	339 400	(395)	(0,01)
Indice iTraxx Europe Main 38 à 5 ans	(1,000)	20/12/2027	€ 46 000	(647)	(0,02)
				$ (4 903)	(0,12)

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	0,900 %	10/03/2052	£ 6 600	$ 3 205	0,08
À recevoir	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	0,900	11/03/2052	6 600	3 696	0,09
À recevoir	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	0,900	15/03/2052	8 400	3 872	0,09

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance		Montant notionnel		Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000 %	15/03/2033	£	25 700	$	333	0,01
À recevoir[4]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053		6 300		55	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,062	18/09/2026	¥	3 550 000		(595)	(0,01)
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,063	19/09/2026		7 000		(1)	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,064	19/09/2026		877 000		(149)	0,00
À payer	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,380	18/06/2028		5 170 000		(909)	(0,02)
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,500	15/03/2042		4 651 000		3 044	0,07
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,662	19/04/2042		260 000		189	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,705	31/10/2038		1 180 000		554	0,01
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,750	20/03/2038		436 000		144	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,750	20/12/2038		1 947 000		923	0,02
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,785	12/11/2038		600 000		267	0,01
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,800	22/10/2038		400 000		170	0,00
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,800	15/06/2052		4 070 000		3 875	0,09
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,573	28/02/2027	$	5 500		(483)	(0,01)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,635	18/04/2027		30 000		(2 625)	(0,06)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,690	19/04/2027		30 000		(2 545)	(0,06)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,730	24/02/2032		14 800		(2 072)	(0,05)
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	21/12/2052		65 900		4 522	0,11
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,765	16/03/2032		45 000		(6 195)	(0,15)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,783	22/04/2027		16 200		(1 307)	(0,03)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,943	21/04/2032		14 800		(1 826)	(0,04)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,150	15/06/2027		88 100		(5 894)	(0,14)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,680	11/07/2032		31 600		(1 842)	(0,04)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,690	11/07/2032		31 600		(1 809)	(0,04)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,050	08/09/2029		6 800		(202)	0,00
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	3,050	14/12/2052		12 100		451	0,01
À recevoir[4]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	4,270	13/09/2024		51 400		68	0,00
À recevoir[4]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	4,350	14/09/2024		31 000		16	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	7,900	02/01/2024	BRL	8 600		27	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	10,838	02/01/2025		385 800		(2 772)	(0,07)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,065	02/01/2024		115 000		(615)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,371	02/01/2025		144 500		(766)	(0,02)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,587	02/01/2025		135 800		467	0,01
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,663	02/01/2025		242 300		737	0,02
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,692	02/01/2025		344 400		1 017	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	12,005	02/01/2025		139 300		(359)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,030	02/01/2024		202 300		673	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	12,195	02/01/2025		68 200		(144)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,200	02/01/2025		151 400		(293)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,275	02/01/2025		41 300		(76)	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,590	02/01/2025		49 300		(38)	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,835	02/01/2024		116 600		129	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,958	02/01/2024		114 600		95	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,980	04/01/2027		93 500		194	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	12,990	04/01/2027		46 800		99	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	13,024	04/01/2027		46 800		106	0,00
À payer	BBR NZD à 3 mois	3,750	15/06/2027	NZD	39 100		(642)	(0,02)
À payer[4]	BBR NZD à 3 mois	4,000	14/06/2024		115 900		(734)	(0,02)
À payer	BBR NZD à 3 mois	4,250	21/12/2027		3 300		(59)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	€	4 000		(172)	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,650	12/04/2027		25 000		(2 564)	(0,06)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027		21 000		(1 856)	(0,04)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,580	24/05/2024		239 500		(4 809)	(0,12)
À payer[4]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033		141 600		(17 576)	(0,42)
						$	(33 001)	(0,79)
Total des Instruments financiers dérivés compensés						**$**	**(35 039)**	**(0,84)**

(1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(3) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(4) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,750 %	12/09/2023	124 000	$ 992	$ 1 008	0,03
FAR	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,750	11/09/2023	116 900	877	950	0,02
MYC	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,750	11/09/2023	116 700	887	948	0,02
							$ 2 756	$ 2 906	0,07

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente - Indice iTraxx Europe 37 à 5 ans hors cote	Vente	3,000 %	15/03/2023	6 100	$ (11)	$ (1)	0,00

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,250 %	12/09/2023	124 000	$ (620)	$ (627)	(0,02)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,750	12/09/2023	124 000	(372)	(353)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,150	01/12/2023	68 600	(213)	(49)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,650	01/12/2023	68 600	(213)	(519)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,870	23/01/2023	2 300	(17)	(7)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,320	23/01/2023	2 300	(17)	(29)	0,00
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,900	17/01/2023	4 100	(17)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	17/01/2023	4 100	(17)	(69)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,610	17/01/2023	2 000	(18)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,110	17/01/2023	2 000	(18)	(57)	0,00
FAR	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,233	11/09/2023	116 900	(549)	(602)	(0,02)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,715	11/09/2023	116 900	(327)	(347)	(0,01)
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	12/01/2023	5 100	(28)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,550	12/01/2023	5 100	(28)	(43)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547	07/03/2023	7 400	(163)	(17)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	7 400	(163)	(466)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	9 100	(107)	(23)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	9 100	(126)	(298)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,740	19/01/2023	2 000	(17)	(1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,180	19/01/2023	2 000	(17)	(45)	0,00
MYC	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,233	11/09/2023	116 700	(560)	(601)	(0,01)
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 1 an hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	4,715	11/09/2023	116 700	(327)	(346)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,070	23/01/2023	4 300	(21)	(3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,520	23/01/2023	4 300	(21)	(51)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,600	17/01/2023	2 100	(16)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,050	17/01/2023	2 100	(16)	(77)	0,00
							$ (4 008)	$ (4 631)	(0,11)

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	$ 99,813	06/02/2023	700	$ (5)	$ (4)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	100,000	06/02/2023	500	(3)	(4)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	101,813	06/02/2023	700	(4)	(2)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	102,000	06/02/2023	500	(3)	(1)	0,00
SAL	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	101,859	05/01/2023	9 600	(28)	0	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	102,250	05/01/2023	7 000	(21)	0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	99,750	06/02/2023	4 800	(34)	(29)	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	100,000	06/02/2023	3 200	(22)	(22)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	101,750	06/02/2023	4 800	(28)	(11)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	102,000	06/02/2023	3 200	(19)	(6)	0,00
					$ (167)	$ (79)	0,00

(1) Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000 %	20/06/2027	$ 1 600	$ (77)	$ (18)	$ (95)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	400	(36)	7	(29)	0,00
BRC	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2026	2 325	(108)	1	(107)	0,00
CBK	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	700	(25)	(17)	(42)	0,00
GST	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	3 000	(112)	(66)	(178)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	1 300	(116)	22	(94)	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2026	2 275	(104)	0	(104)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	400	(15)	(9)	(24)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement sud-africain	1,000	20/12/2023	100	(5)	5	0	0,00
MYC	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/06/2027	2 900	(104)	(69)	(173)	(0,01)
	Obligation internationale du gouvernement colombien	1,000	20/12/2027	3 400	(303)	56	(247)	(0,01)
					$ (1 005)	$ (88)	$ (1 093)	(0,03)

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€	10 994	$	11 620	$ 0	$ (118)	$ (118)	0,00
	01/2023	$	1 250	€	1 176	5	0	5	0,00
	01/2023		4 153	£	3 458	7	0	7	0,00
	02/2023		5 628	¥	752 000	112	(9)	103	0,00
	03/2023	ILS	7 339	$	2 163	77	0	77	0,00
	05/2023	PEN	16 565		4 222	0	(77)	(77)	0,00
BPS	01/2023	$	5 544	€	5 200	8	0	8	0,00
	01/2023		1 178	£	975	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023		143	ILS	489	0	(4)	(4)	0,00
	03/2023	INR	8 501	$	102	0	0	0	0,00
	03/2023	$	15 473	CLP	14 941 563	1 877	0	1 877	0,05
	03/2023		319	PEN	1 241	4	0	4	0,00
BRC	01/2023		2 888	£	2 338	0	(75)	(75)	0,00
CBK	01/2023	CLP	14 659 223	$	15 385	0	(1 810)	(1 810)	(0,04)
	01/2023	€	4 275		4 519	0	(46)	(46)	0,00
	01/2023	PEN	37 053		9 206	0	(489)	(489)	(0,01)
	01/2023	$	7 962	CAD	10 756	0	(24)	(24)	0,00
	01/2023		16 484	CLP	14 664 168	716	0	716	0,02
	01/2023		14 941	€	14 083	95	0	95	0,00
	02/2023	CLP	14 744 940	$	16 484	0	(728)	(728)	(0,02)
	02/2023	PEN	10 603		2 659	0	(113)	(113)	0,00
	02/2023	$	20 986	BRL	113 258	349	0	349	0,01
	03/2023	PEN	13 369	$	3 325	0	(161)	(161)	0,00
	03/2023	$	440	PEN	1 728	10	0	10	0,00
	05/2023	ILS	41 467	$	12 431	595	0	595	0,01
	05/2023	PEN	44 643		11 075	0	(515)	(515)	(0,01)
CLY	03/2023	$	1 959	PEN	7 534	4	0	4	0,00
DUB	03/2023	ILS	35 310	$	10 411	374	0	374	0,01
GLM	01/2023	CNH	297		43	0	0	0	0,00
	01/2023	HKD	3 546		456	1	0	1	0,00
	01/2023	HUF	2 077 171		5 318	0	(218)	(218)	(0,01)
	03/2023	MXN	2 194		107	0	(4)	(4)	0,00
	05/2023	$	11 078	PEN	44 209	393	0	393	0,01
JPM	02/2023	TWD	171	$	6	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	AUD	4 107		2 781	7	(11)	(4)	0,00
	01/2023	£	168		206	3	0	3	0,00
	01/2023	HKD	14 719		1 891	4	0	4	0,00
	01/2023	$	15 141	€	14 227	49	0	49	0,00
	01/2023		4 148	£	3 404	0	(52)	(52)	0,00
	02/2023	¥	4 154 600	$	30 017	0	(1 688)	(1 688)	(0,04)
	05/2023	CNH	58 919		8 779	181	0	181	0,00
MYI	01/2023	AUD	45 113		30 295	0	(305)	(305)	(0,01)
	01/2023	€	1 221		1 301	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023	PEN	25 740		6 645	0	(89)	(89)	0,00
	01/2023	SGD	94		70	0	0	0	0,00
	01/2023	$	186	£	154	0	0	0	0,00
	01/2023		4	SGD	6	0	0	0	0,00
	02/2023	TWD	316	$	10	0	0	0	0,00
RBC	01/2023	AUD	520		348	0	(4)	(4)	0,00
SCX	01/2023	CAD	15 783		11 748	99	0	99	0,00
	01/2023	€	800 094		832 778	0	(21 488)	(21 488)	(0,52)
	01/2023	NZD	3 254		2 027	0	(31)	(31)	0,00
	01/2023	$	25 464	£	20 567	0	(720)	(720)	(0,02)
	01/2023		989	PEN	3 796	6	0	6	0,00

Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	02/2023	TWD	3 151	$	102	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	03/2023	CLP	385 592		432	0	(16)	(16)	0,00
	03/2023	PEN	3 988		1 036	0	(3)	(3)	0,00
	03/2023	$	1 394	PEN	5 387	9	0	9	0,00
	04/2023		2 852		11 545	146	0	146	0,00
TOR	01/2023	CAD	40 123	$	29 847	234	0	234	0,01
	01/2023	£	255 908		307 676	0	(206)	(206)	(0,01)
UAG	01/2023	CZK	5 209		205	0	(25)	(25)	0,00
	05/2023	$	8 473	CNH	58 716	96	0	96	0,00
						$ 5 461	$ (29 038)	$ (23 577)	(0,57)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CAD (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	CAD	6 407	$	4 702	$ 0	$ (27)	$ (27)	0,00
BOA	01/2023	$	2 998	CAD	4 053	0	(6)	(6)	0,00
CBK	01/2023	CAD	81	$	60	0	0	0	0,00
MBC	01/2023	$	5 523	CAD	7 473	0	(8)	(8)	0,00
MYI	01/2023	CAD	81	$	60	0	0	0	0,00
	01/2023	$	14	CAD	19	0	0	0	0,00
SCX	01/2023		1 403		1 885	0	(12)	(12)	0,00
TOR	01/2023		4 949		6 653	0	(39)	(39)	0,00
						$ 0	$ (92)	$ (92)	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en CHF (couverte) de capitalisation, Investisseurs en CHF (couverte) de capitalisation et E en CHF (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	6 327	CHF	5 979	$ 140	$ 0	$ 140	0,00
BRC	01/2023		8		8	0	0	0	0,00
CBK	01/2023		10 180		9 617	221	0	221	0,01
MBC	01/2023	CHF	130	$	140	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	295	CHF	272	0	0	0	0,00
MYI	01/2023	CHF	28	$	31	0	0	0	0,00
SCX	01/2023		9		9	0	0	0	0,00
	01/2023	$	141	CHF	131	1	0	1	0,00
UAG	01/2023	CHF	17	$	19	0	0	0	0,00
						$ 362	$ (1)	$ 361	0,01

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation, Administrations en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de capitalisation, E en EUR (couverte) de distribution, R en EUR (couverte) de capitalisation et T en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	643	€	610	$ 8	$ 0	$ 8	0,00
BPS	01/2023		2 472		2 318	3	0	3	0,00
CBK	01/2023	€	6 485	$	6 913	0	(10)	(10)	0,00
	01/2023	$	372 774	€	359 186	10 729	0	10 729	0,26
MBC	01/2023	€	196	$	207	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023	$	435 363	€	415 264	8 017	0	8 017	0,19
SCX	01/2023		389 990		374 685	10 062	0	10 062	0,24
						$ 28 819	$ (12)	$ 28 807	0,69

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£	38	$	46	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$	359	£	295	0	(4)	(4)	0,00
BPS	01/2023		11		9	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	£	171	$	205	0	0	0	0,00
JPM	01/2023	$	13 134	£	10 877	0	(48)	(48)	0,00
MBC	01/2023	£	636	$	778	13	0	13	0,00
	01/2023	$	13 309	£	11 092	53	(18)	35	0,00
MYI	01/2023		414		337	0	(9)	(9)	0,00
TOR	01/2023		13 090		10 888	9	0	9	0,00
UAG	01/2023		165		134	0	(5)	(5)	0,00
						$ 75	$ (84)	$ (9)	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en SGD (couverte) de capitalisation et E en SGD (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$ 18	SGD 24	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BOA	01/2023	12 174	16 707	285	0	285	0,01
BPS	01/2023	13 178	18 067	294	0	294	0,01
GLM	01/2023	SGD 10	$ 7	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 619	SGD 847	12	0	12	0,00
MBC	01/2023	SGD 7 787	$ 5 739	0	(68)	(68)	(0,01)
	01/2023	$ 12 761	SGD 17 446	249	0	249	0,01
RBC	01/2023	SGD 15	$ 11	0	0	0	0,00
RYL	01/2023	$ 58	SGD 79	1	0	1	0,00
SCX	01/2023	6	7	0	0	0	0,00
SOG	01/2023	SGD 7 051	$ 5 224	0	(34)	(34)	0,00
UAG	01/2023	217	158	0	(4)	(4)	0,00
	01/2023	$ 24	SGD 32	0	0	0	0,00
				$ 841	$ (106)	$ 735	0,02
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						**$ 3 327**	**0,08**

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
2,000 % éch. 01/02/2053	$ 32 300	$ (26 317)	(0,63)
2,500 % éch. 01/02/2053	49 700	(42 140)	(1,02)
Total des Titres vendus à découvert		**$ (68 457)**	**(1,65)**
Total des Investissements		**$ 5 169 865**	**124,55**
Autres actifs et passifs à court terme		**$ (1 019 148)**	**(24,55)**
Actif net		**$ 4 150 717**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à coupon zéro.

(b) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(c) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

(d) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titre convertible conditionnel.

(g) Des titres d'une juste valeur globale de 1 858 $ (31 décembre 2021 : 226 010 $) et un montant en numéraire de 0 $ (31 décembre 2021 : 38 $) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

(h) Un titre d'une juste valeur globale de 25 953 $ (31 décembre 2021 : 0 $) a été nanti ou livré en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 94 783 $ (31 décembre 2021 : 70 987 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 13 885 $ (31 décembre 2021 : 19 884 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 4 765 456	$ 5 405	$ 4 770 861
Fonds d'investissement	292 421	0	0	292 421
Contrats de mise en pension	0	170 895	0	170 895
Instruments financiers dérivés[3]	39 217	(35 072)	0	4 145
Titres vendus à découvert	0	(68 457)	0	(68 457)
Totaux	**$ 331 638**	**$ 4 832 822**	**$ 5 405**	**$ 5 169 865**

Tableau des investissements Fonds Total Return Bond Fund (suite)

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 5 405 196	$ 0	$ 5 405 196
Fonds d'investissement	423 494	0	0	423 494
Contrats de mise en pension	0	7 152	0	7 152
Instruments financiers dérivés[3]	11 552	(9 935)	0	1 617
Totaux	**$ 435 046**	**$ 5 402 413**	**$ 0**	**$ 5 837 459**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Contrats de prise en pension au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur contrats de prise en pension	En % de l'actif net
BRC	0,550 %	21/09/2022	À définir[1]	€ (438)	$ (468)	(0,01)
	0,600	20/09/2022	À définir[1]	(1 196)	(1 277)	(0,03)
Total des Contrats de prise en pension					**$ (1 745)**	**(0,04)**

(1) Contrats de prise en pension à échéance ouverte.

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos[1]	En % de l'actif net
BPG	(1,500) %	30/12/2022	03/01/2023	$ (26 267)	$ (26 264)	(0,63)
	(1,350)	29/12/2022	30/12/2022	(25 647)	(25 646)	(0,62)
	(1,000)	28/12/2022	29/12/2022	(24 900)	(24 899)	(0,60)
Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos					**$ (76 809)**	**(1,85)**

(1) Le montant à payer sur les opérations par vente et rachat dos-à-dos comprend 1 $ de baisse de prix différée.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ (27)	$ 0	$ (27)	$ S/O	$ S/O	$ S/O
BOA	(167)	280	113	(530)	260	(270)
BPS	1 927	(1 740)	187	(1 860)	1 690	(170)
BRC	(182)	20	(162)	8	0	8
CBK	8 777	(8 710)	67	(3 347)	3 582	235
CLY	4	0	4	S/O	S/O	S/O
DUB	374	(270)	104	(1)	0	(1)
FAR	1	0	1	S/O	S/O	S/O
GLM	(710)	600	(110)	(2 389)	2 430	41
GSC	S/O	S/O	S/O	(6)	0	(6)
GST	(273)	260	(13)	14	0	14
HUS	S/O	S/O	S/O	(1 776)	1 610	(166)
JPM	(176)	0	(176)	(1 072)	940	(132)
MBC	6 728	(6 220)	508	S/O	S/O	S/O
MYC	(550)	470	(80)	S/O	S/O	S/O
MYI	(406)	270	(136)	(370)	560	190
RBC	(4)	0	(4)	(3 080)	1 730	(1 350)
RYL	1	0	1	S/O	S/O	S/O
SAL	(68)	0	(68)	(121)	202	81
SCX	(11 948)	11 385	(563)	(6 511)	6 880	369
SOG	(34)	0	(34)	S/O	S/O	S/O
TOR	(2)	600	598	2 233	(1 550)	683
UAG	62	0	62	755	(650)	105

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	66,92	66,72
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	47,33	41,50
Autres valeurs mobilières	0,68	1,09
Fonds d'investissement	7,05	8,56
Contrats de mise en pension	4,12	0,14
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,86	0,28
Instruments financiers dérivés compensés	(0,84)	0,12
Instruments financiers dérivés hors cote	0,08	(0,36)
Titres vendus à découvert	(1,65)	S/O
Contrats de prise en pension	(0,04)	(4,57)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	(1,85)	S/O

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Obligations et billets privés	36,37	48,35
Obligations et billets municipaux	0,28	0,62
Agences du gouvernement américain	37,34	19,94
Obligations du Trésor américain	17,09	15,86
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	9,41	10,80
Titres adossés à des actifs	9,66	8,48
Émissions souveraines	2,46	3,77
Instruments à court terme	2,32	1,49
Fonds d'investissement	7,05	8,56
Contrats de mise en pension	4,12	0,14
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,87	0,28
Options vendues		
Options sur contrats à terme standardisés négociés en bourse	(0,01)	0,00
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - achat de protection	0,00	S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,07	0,06
Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection	(0,12)	0,00
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	S/O	0,00
Swaps de taux d'intérêt	(0,79)	0,06
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,07	0,08
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	S/O
Swaptions de taux d'intérêt	(0,11)	(0,15)
Options sur titres	0,00	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,03)	0,00
Contrats de change à terme	(0,57)	(0,62)
Contrats de change à terme couverts	0,72	0,33
Titres vendus à découvert	(1,65)	S/O
Autres actifs et passifs à court terme	(24,55)	(18,05)
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				
American Express Co.				
4,785 % éch. 03/05/2024	$	1 400	1 399	0,32
American Tower Corp.				
3,000 % éch. 15/06/2023		1 000	990	0,23
3,500 % éch. 31/01/2023		2 425	2 422	0,56
Aozora Bank Ltd.				
1,050 % éch. 09/09/2024		500	464	0,11
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
0,875 % éch. 18/09/2023		3 600	3 487	0,80
Bank of America Corp.				
5,555 % éch. 05/03/2024		100	100	0,02
Bank of Nova Scotia				
0,550 % éch. 15/09/2023		1 000	969	0,22
5,245 % éch. 11/03/2024		500	499	0,11
Barclays PLC				
4,967 % éch. 15/06/2023	AUD	500	339	0,08
BNP Paribas S.A.				
3,500 % éch. 01/03/2023	$	1 500	1 496	0,34
3,800 % éch. 10/01/2024		2 133	2 097	0,48
BPCE S.A.				
4,000 % éch. 12/09/2023		1 500	1 484	0,34
Canadian Imperial Bank of Commerce				
5,122 % éch. 17/03/2023		2 500	2 503	0,57
Capital One Financial Corp.				
5,476 % éch. 09/05/2025		2 400	2 372	0,54
Citigroup, Inc.				
1,678 % éch. 15/05/2024		1 000	986	0,23
5,750 % éch. 17/05/2024		300	301	0,07
CK Hutchison International Ltd.				
3,250 % éch. 11/04/2024		1 000	977	0,22
CNH Industrial Capital LLC				
1,950 % éch. 02/07/2023		1 800	1 770	0,41
Cooperatieve Rabobank UA				
1,980 % éch. 15/12/2027		500	435	0,10
Credit Suisse AG				
4,260 % éch. 26/05/2023	AUD	1 000	673	0,15
Danske Bank A/S				
5,375 % éch. 12/01/2024	$	900	893	0,20
5,795 % éch. 12/09/2023		2 138	2 138	0,49
Deutsche Bank AG				
0,898 % éch. 28/05/2024 (d)		1 000	936	0,21
3,950 % éch. 27/02/2023		2 000	1 993	0,46
Fédération des Caisses Desjardins du Québec				
4,618 % éch. 21/05/2024		500	494	0,11
First Abu Dhabi Bank PJSC				
4,145 % éch. 18/02/2025	AUD	500	337	0,08
5,400 % éch. 08/08/2023	$	1 000	1 000	0,23
Five Corners Funding Trust				
4,419 % éch. 15/11/2023		2 500	2 479	0,57
GA Global Funding Trust				
5,085 % éch. 11/04/2025		700	685	0,16
General Motors Financial Co., Inc.				
3,250 % éch. 05/01/2023		2 250	2 250	0,52
4,738 % éch. 05/01/2023		592	592	0,14
Goldman Sachs Group, Inc.				
4,605 % éch. 02/05/2024	AUD	1 300	884	0,20
6,334 % éch. 29/11/2023	$	2 700	2 721	0,62
HSBC Holdings PLC				
5,965 % éch. 11/03/2025		800	793	0,18
Huntington National Bank				
5,345 % éch. 16/05/2025		1 100	1 093	0,25
Hyundai Capital Services, Inc.				
3,750 % éch. 05/03/2023		1 270	1 266	0,29
ING Bank Australia Ltd.				
4,000 % éch. 26/05/2025	AUD	1 600	1 062	0,24
ING Groep NV				
4,100 % éch. 02/10/2023	$	1 700	1 687	0,39
Jackson Financial, Inc.				
1,125 % éch. 22/11/2023		1 000	963	0,22
Jackson National Life Global Funding				
5,473 % éch. 28/06/2024		400	400	0,09
JPMorgan Chase & Co.				
0,969 % éch. 23/06/2025	$	1 000	933	0,21
3,559 % éch. 23/04/2024		2 000	1 987	0,46
Mitsubishi HC Capital, Inc.				
3,960 % éch. 19/09/2023		2 800	2 769	0,64
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
0,848 % éch. 15/09/2024		2 000	1 931	0,44
3,837 % éch. 17/04/2026		500	482	0,11
5,187 % éch. 26/07/2023		1 000	1 002	0,23
Mizuho Financial Group, Inc.				
3,549 % éch. 05/03/2023		300	299	0,07
4,899 % éch. 10/07/2024		1 100	1 098	0,25
5,555 % éch. 05/03/2023		250	250	0,06
Morgan Stanley				
0,529 % éch. 25/01/2024		2 500	2 483	0,57
Nationwide Building Society				
0,550 % éch. 22/01/2024		600	570	0,13
3,766 % éch. 08/03/2024		3 800	3 779	0,86
NatWest Group PLC				
6,274 % éch. 25/06/2024		1 000	1 000	0,23
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
5,375 % éch. 08/03/2024		700	689	0,16
Nomura Holdings, Inc.				
2,648 % éch. 16/01/2025		3 300	3 118	0,72
Nordea Bank Abp				
5,675 % éch. 30/08/2023		1 000	1 001	0,23
ORIX Corp.				
4,050 % éch. 16/01/2024		3 000	2 958	0,68
Pacific Life Global Funding				
4,867 % éch. 04/06/2026		1 200	1 153	0,26
Protective Life Global Funding				
0,502 % éch. 12/04/2023		1 400	1 383	0,32
Reliance Standard Life Global Funding				
2,150 % éch. 21/01/2023		2 000	1 997	0,46
Santander UK Group Holdings PLC				
3,373 % éch. 05/01/2024		1 500	1 500	0,34
4,796 % éch. 15/11/2024		1 500	1 475	0,34
Société Générale S.A.				
4,250 % éch. 14/09/2023		1 661	1 647	0,38
Standard Chartered PLC				
5,123 % éch. 23/11/2025		200	194	0,04
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
4,318 % éch. 07/03/2023	AUD	1 200	814	0,19
Toronto-Dominion Bank				
5,183 % éch. 08/03/2024	$	200	200	0,05
UBS AG				
4,565 % éch. 09/08/2024		1 200	1 192	0,27
			88 333	20,25
INDUSTRIE				
7-Eleven, Inc.				
0,625 % éch. 10/02/2023		2 500	2 487	0,57
Altria Group, Inc.				
2,950 % éch. 02/05/2023		2 000	1 985	0,46
Ausgrid Finance Pty. Ltd.				
3,750 % éch. 30/10/2024	AUD	1 000	664	0,15
3,850 % éch. 01/05/2023	$	1 500	1 493	0,34
Barry Callebaut Services NV				
5,500 % éch. 15/06/2023		2 500	2 489	0,57
BAT Capital Corp.				
3,222 % éch. 15/08/2024		1 000	964	0,22
Baxter International, Inc.				
4,495 % éch. 01/12/2023		3 500	3 474	0,80
Bayer U.S. Finance LLC				
5,779 % éch. 15/12/2023		2 800	2 794	0,64
Boeing Co.				
1,167 % éch. 04/02/2023		600	598	0,14
1,875 % éch. 15/06/2023		500	492	0,11
4,508 % éch. 01/05/2023		3 000	2 995	0,69
Central Japan Railway Co.				
3,400 % éch. 06/09/2023		900	890	0,20
Charter Communications Operating LLC				
6,090 % éch. 01/02/2024		500	502	0,12
Cigna Corp.				
4,969 % éch. 15/07/2023		1 400	1 403	0,32
CNH Industrial NV				
4,500 % éch. 15/08/2023	$	1 606	1 596	0,37
Daimler Trucks Finance North America LLC				
1,125 % éch. 14/12/2023		1 500	1 442	0,33
4,918 % éch. 14/12/2023		1 565	1 556	0,36
Dell International LLC				
5,450 % éch. 15/06/2023		1 007	1 008	0,23
Gilead Sciences, Inc.				
0,750 % éch. 29/09/2023		1 900	1 841	0,42
HCA, Inc.				
5,000 % éch. 15/03/2024		1 100	1 094	0,25
Heineken NV				
2,750 % éch. 01/04/2023		4 000	3 976	0,91
Hyundai Capital America				
0,800 % éch. 08/01/2024		2 000	1 903	0,44
Illumina, Inc.				
0,550 % éch. 23/03/2023		2 000	1 980	0,45
Imperial Brands Finance PLC				
3,125 % éch. 26/07/2024		1 100	1 052	0,24
Kinder Morgan, Inc.				
5,359 % éch. 15/01/2023		1 000	1 000	0,23
Leidos, Inc.				
2,950 % éch. 15/05/2023		3 685	3 656	0,84
Mercedes-Benz Finance North America LLC				
5,500 % éch. 27/11/2024		800	805	0,18
Microchip Technology, Inc.				
4,333 % éch. 01/06/2023		1 000	996	0,23
Mitsubishi Corp.				
3,375 % éch. 23/07/2024		600	582	0,13
Nissan Motor Co. Ltd.				
3,043 % éch. 15/09/2023		1 600	1 568	0,36
NXP BV				
4,875 % éch. 01/03/2024		1 500	1 489	0,34
Penske Truck Leasing Co. LP				
4,250 % éch. 17/01/2023		1 400	1 400	0,32
SK Broadband Co. Ltd.				
3,875 % éch. 13/08/2023		1 000	992	0,23
SK Hynix, Inc.				
1,000 % éch. 19/01/2024		600	570	0,13
Stellantis NV				
5,250 % éch. 15/04/2023		2 070	2 072	0,48
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.				
3,900 % éch. 22/03/2023		4 162	4 151	0,95
Takeda Pharmaceutical Co. Ltd.				
4,400 % éch. 26/11/2023		333	330	0,08
Thermo Fisher Scientific, Inc.				
4,160 % éch. 18/04/2023		600	599	0,14
Time Warner Cable Enterprises LLC				
8,375 % éch. 15/03/2023		2 793	2 811	0,64
Tyson Foods, Inc.				
3,900 % éch. 28/09/2023		1 000	991	0,23
Zoetis, Inc.				
3,250 % éch. 01/02/2023		1 500	1 498	0,34
			66 188	15,18
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
AT&T, Inc.				
5,540 % éch. 15/02/2023		400	400	0,09
Atmos Energy Corp.				
5,103 % éch. 09/03/2023		1 100	1 099	0,25
British Telecommunications PLC				
4,500 % éch. 04/12/2023		2 700	2 678	0,62
Chugoku Electric Power Co., Inc.				
2,401 % éch. 27/08/2024		1 000	951	0,22
Dominion Energy, Inc.				
2,450 % éch. 15/01/2023		1 400	1 399	0,32
Duke Energy Corp.				
4,534 % éch. 10/06/2023		500	499	0,12
Enel Finance International NV				
2,650 % éch. 10/09/2024		1 000	957	0,22
Hydro One, Inc.				
0,710 % éch. 16/01/2023	CAD	300	221	0,05
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
5,342 % éch. 21/03/2024	$	500	497	0,11
Oklahoma Gas & Electric Co.				
0,553 % éch. 26/05/2023		1 500	1 473	0,34

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Pacific Gas & Electric Co.				
1,700 % éch. 15/11/2023	$	600	$ 581	0,13
4,250 % éch. 01/08/2023		800	796	0,18
Plains All American Pipeline LP				
2,850 % éch. 31/01/2023		1 300	1 298	0,30
Southern California Gas Co.				
5,103 % éch. 14/09/2023		1 500	1 496	0,34
Verizon Communications, Inc.				
5,706 % éch. 15/05/2025		1 500	1 513	0,35
Victoria Power Networks Finance Pty. Ltd.				
3,570 % éch. 23/08/2024	AUD	500	336	0,08
			16 194	3,72
Total des Obligations et billets privés			170 715	39,15
OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX				
Obligations California Infrastructure & Economic Development Bank Revenue Bonds, Series 2020				
0,850 % éch. 01/01/2050	$	1 000	998	0,23
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Ginnie Mae				
4,398 % éch. 20/09/2066		525	536	0,12
4,672 % éch. 20/08/2066		515	510	0,12
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				
5,500 % éch. 01/02/2053		5 000	5 011	1,15
			6 057	1,39
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
DBWF Mortgage Trust				
5,469 % éch. 19/12/2030		500	486	0,11
Dilosk RMBS DAC				
2,552 % éch. 20/02/2060	€	339	359	0,08
Sage AR Funding PLC				
4,501 % éch. 17/11/2030	£	200	231	0,05
Towd Point Mortgage Funding PLC				
4,071 % éch. 20/10/2051		210	251	0,06
Towd Point Mortgage Trust				
3,773 % éch. 25/02/2057	$	101	100	0,02
Trinity Square PLC				
3,729 % éch. 15/07/2059	£	144	171	0,04
Tudor Rose Mortgages				
4,031 % éch. 20/06/2048		321	381	0,09
			1 979	0,45
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Carlyle Euro CLO DAC				
2,688 % éch. 15/08/2032	€	300	311	0,07
CBAM CLO Ltd.				
5,363 % éch. 20/10/2029	$	549	542	0,13
EFS Volunteer LLC				
5,208 % éch. 25/10/2035		133	133	0,03
Elevation CLO Ltd.				
5,355 % éch. 15/10/2029		840	835	0,19
Euro-Galaxy CLO DAC				
2,122 % éch. 24/04/2034	€	250	259	0,06
Greenwood Park CLO Ltd.				
5,089 % éch. 15/04/2031	$	1 600	1 580	0,36
Harvest CLO DAC				
2,775 % éch. 26/06/2030	€	241	252	0,06
Oak Hill European Credit Partners DAC				
2,196 % éch. 20/10/2031		300	310	0,07

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
SLM Private Credit Student Loan Trust				
5,059 % éch. 15/06/2039	$	410	$ 386	0,09
			4 608	1,06
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi				
0,750 % éch. 02/09/2023		1 500	1 456	0,34
Obligation internationale du gouvernement israélien				
1,500 % éch. 30/11/2023	ILS	100	28	0,01
Korea National Oil Corp.				
4,954 % éch. 16/07/2023	$	800	801	0,18
			2 285	0,53
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BILLETS DE TRÉSORERIE				
American Electric Power Co., Inc.				
4,800 % éch. 04/01/2023		1 400	1 399	0,32
Bacardi-Martini B.V.				
5,170 % éch. 11/01/2023		1 600	1 598	0,37
5,250 % éch. 12/01/2023		1 500	1 498	0,34
Bank of Nova Scotia				
4,318 % éch. 01/02/2023	CAD	2 000	1 470	0,34
4,351 % éch. 06/02/2023		4 200	3 085	0,71
BP Capital Markets PLC				
4,750 % éch. 10/02/2023	$	1 300	1 293	0,30
Crown Castle International Corp.				
5,000 % éch. 04/01/2023		1 500	1 499	0,34
5,100 % éch. 05/01/2023		1 500	1 499	0,34
5,150 % éch. 10/01/2023		800	799	0,18
Dominion Resources, Inc.				
4,750 % éch. 31/01/2023		400	398	0,09
Duke Energy Corp.				
4,620 % éch. 11/01/2023		1 500	1 498	0,34
4,620 % éch. 17/01/2023		250	249	0,06
4,650 % éch. 09/01/2023		800	799	0,18
Energy Transfer Partners LP				
5,080 % éch. 05/01/2023		1 900	1 898	0,43
Entergy Corp.				
4,700 % éch. 12/01/2023		2 300	2 296	0,53
Fiserv, Inc.				
4,630 % éch. 09/01/2023		1 300	1 298	0,30
Humana, Inc.				
4,900 % éch. 01/02/2023		2 000	1 991	0,46
Mercedes-Benz Finance North America LLC				
4,800 % éch. 30/01/2023		2 100	2 092	0,48
National Grid Holdings Ltd.				
4,810 % éch. 24/01/2023		250	249	0,06
Oracle Corp.				
4,760 % éch. 27/01/2023		1 400	1 395	0,32
4,800 % éch. 26/01/2023		2 500	2 491	0,57
Quanta Services, Inc.				
5,100 % éch. 09/01/2023		1 100	1 099	0,25
5,100 % éch. 11/01/2023		900	899	0,21
Republic Services, Inc.				
4,650 % éch. 12/01/2023		4 000	3 993	0,92
Royal Bank of Canada				
4,291 % éch. 31/01/2023	CAD	2 400	1 764	0,40
4,312 % éch. 06/02/2023		6 000	4 407	1,01
Toronto-Dominion Bank				
4,261 % éch. 13/01/2023		7 500	5 525	1,27
Vodafone Group PLC				
4,600 % éch. 05/01/2023	$	2 500	2 498	0,57

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Walgreens Boots Alliance, Inc.				
4,900 % éch. 11/01/2023	$	2 300	$ 2 296	0,53
			53 275	12,22
BILLETS À COURT TERME				
Federal Home Loan Bank				
4,320 % éch. 11/01/2023		3 000	3 000	0,69
4,345 % éch. 06/03/2023		12 000	12 001	2,75
			15 001	3,44
BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN				
0,526 % éch. 08/02/2023 (a)(b)	ILS	26 700	7 539	1,73
1,203 % éch. 02/03/2023 (a)(b)		350	99	0,02
			7 638	1,75
BONS DU TRÉSOR JAPONAIS				
(0,251) % éch. 11/01/2023 (a)(b)	¥	481 500	3 649	0,84
(0,228) % éch. 11/01/2023 (a)(b)		208 500	1 580	0,36
(0,209) % éch. 06/01/2023 (a)(b)		314 000	2 380	0,55
(0,205) % éch. 16/01/2023 (a)(b)		438 000	3 320	0,76
(0,201) % éch. 16/01/2023 (a)(b)		119 000	902	0,21
(0,191) % éch. 06/01/2023 (a)(b)		117 000	887	0,20
(0,190) % éch. 16/01/2023 (a)(b)		427 000	3 236	0,74
(0,175) % éch. 11/01/2023 (a)(b)		680 000	5 154	1,18
(0,170) % éch. 16/01/2023 (a)(b)		2 800 000	21 222	4,87
(0,155) % éch. 30/01/2023 (a)(b)		1 360 000	10 309	2,36
(0,111) % éch. 20/02/2023 (a)(b)		1 590 000	12 053	2,77
			64 692	14,84
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
4,040 % éch. 26/01/2023 (a)(b)	$	2 600	2 593	0,59
4,449 % éch. 30/03/2023 (a)(b)		6 100	6 038	1,39
			8 631	1,98
Total des Instruments à court terme			149 237	34,23
Total des Valeurs mobilières			**$ 335 879**	**77,04**
		ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (c)		1 092 919	10 879	2,49
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE				
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (c)		311 050	30 814	7,07
Total des Fonds d'investissement			**$ 41 693**	**9,56**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BPS	4,100 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 22 700	Billets du Trésor américain 0,375 % échéance 30/11/2025	$ (23 169)	$ 22 700	$ 22 710	5,21
SSB	1,900	30/12/2022	03/01/2023	4 752	Billets du Trésor américain 1,875 % échéance 30/06/2026	(4 847)	4 752	4 753	1,09
Total des Contrats de mise en pension						**$ (28 016)**	**$ 27 452**	**$ 27 463**	**6,30**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Euribor à 3 mois juin	Court	06/2024	112	$ 28	0,01
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Long	09/2023	338	(16)	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2024	166	92	0,02
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Court	06/2024	80	(55)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Indice Amsterdam Index janvier	Long	01/2023	3	(25)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur billet du gouvernement australien à 3 ans mars	Court	03/2023	105	0	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement australien à 10 ans mars	Court	03/2023	106	28	0,01
Contrats à terme standardisés sur Indice BIST 30 Index février	Long	02/2023	2 365	135	0,03
Contrats à terme standardisés sur Indice CAC 40 Index janvier	Long	01/2023	45	(85)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur Indice DAX Index mars	Long	03/2023	3	(32)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini NASDAQ 100 Index mars	Court	03/2023	4	3	0,00
Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini Russell 2000 Index mars	Court	03/2023	4	0	0,00
Contrats à terme standardisés sur Indice E-mini S&P 500 Index mars	Long	03/2023	1	(8)	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro STOXX Bank mars	Long	03/2023	1 430	178	0,04
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-BTP du gouvernement italien mars	Court	03/2023	195	109	0,02
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-OAT du gouvernement français à 10 ans mars	Court	03/2023	24	51	0,01
Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE 100 Index mars	Long	03/2023	92	39	0,01
Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE China A50 Index janvier	Court	01/2023	618	(3)	0,00
Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE Taiwan Index janvier	Court	01/2023	99	41	0,01
Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE/JSE Index mars	Long	03/2023	123	(126)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur Indice FTSE/MIB Index mars	Long	03/2023	16	(36)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur Indice Hang Seng China Enterprises Index janvier	Long	01/2023	2	0	0,00
Contrats à terme standardisés sur IBEX 35 janvier	Long	01/2023	18	(4)	0,00
Contrats à terme standardisés sur Indice MSCI Singapore Index janvier	Court	01/2023	367	6	0,00
Contrats à terme standardisés sur Indice Nikkei 225 Index mars	Court	03/2023	26	34	0,01
Contrats à terme standardisés sur Indice OMXS30 Index janvier	Long	01/2023	128	(88)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur Indice S&P CNX Nifty Index janvier	Long	01/2023	72	1	0,00
Contrats à terme standardisés sur S&P/Toronto Stock Exchange 60 mars	Long	03/2023	13	(77)	(0,02)
Contrats à terme standardisés sur Indice SPI 200 Index mars	Long	03/2023	60	(136)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur Swiss Market mars	Court	03/2023	29	(19)	0,00
Contrats à terme standardisés sur Indice Topix Index mars	Court	03/2023	4	2	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Court	03/2023	24	22	0,01
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Court	03/2023	262	41	0,01
Contrats à terme standardisés sur Indice Volatility S&P 500 Index janvier	Court	01/2023	279	418	0,1
Contrats à terme standardisés sur VSTOXX Mini janvier	Court	01/2023	1 241	96	0,02
Contrats à terme standardisés sur Indice WIG20 Index mars	Court	03/2023	330	(63)	(0,02)
				$ 551	0,13
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ 551**	**0,13**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.EM-35 à 5 ans	1,000 %	20/06/2026	$ 92	$ (1)	0,00
Indice CDX.EM-37 à 5 ans	1,000	20/06/2027	784	21	0,01
Indice CDX.EM-38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	21 100	150	0,03
Indice CDX.HY-38 à 5 ans	5,000	20/06/2027	5 841	10	0,00
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000	20/12/2027	2 400	15	0,00
Indice iTraxx Crossover 38 à 5 ans	5,000	20/12/2027	€ 10 500	198	0,05
				$ 393	0,09

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000 %	15/03/2033	£ 5 900	$ (16)	0,00
À recevoir[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053	800	14	0,00
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	4,175	16/09/2025	INR 33 800	11	0,00
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	4,313	16/12/2025	200	0	0,00
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	4,710	17/03/2026	50 700	22	0,01
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	5,250	15/09/2026	727 500	280	0,06
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	5,260	15/09/2026	242 200	(93)	(0,02)
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	5,400	17/03/2026	85 500	49	0,01
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	5,400	16/06/2026	15 300	8	0,00
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	5,500	15/12/2026	1 400	(1)	0,00
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	5,500	16/03/2027	762 900	(316)	(0,07)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	5,750	16/03/2027	141 100	(34)	(0,01)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,000 %	15/06/2027	INR 168 300	$ 27	0,01
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250	21/09/2027	2 154 300	(588)	(0,13)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,250	21/12/2027	1 397 900	(118)	(0,03)
À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,500	21/12/2027	4 613 820	(214)	(0,05)
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	6,750	21/09/2027	550 400	(131)	(0,03)
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	7,000	15/06/2027	113 900	(38)	(0,01)
À recevoir	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	7,000	21/09/2027	175 050	(64)	(0,01)
À recevoir[3]	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,500	15/03/2033	¥ 2 560 000	113	0,03
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,800	15/06/2052	80 000	24	0,01
À recevoir[3]	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	1,000	15/03/2053	490 000	40	0,01
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	0,750	15/09/2026	SGD 10 000	(206)	(0,05)
À recevoir	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/12/2026	26 990	473	0,11
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	1,250	16/03/2027	12 400	(276)	(0,06)
À recevoir	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	1,500	16/03/2027	2 800	63	0,01
À recevoir	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	2,000	15/06/2027	4 600	71	0,02
À recevoir	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	2,500	15/06/2027	9 200	(2)	0,00
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	2,750	15/06/2027	4 600	(91)	(0,02)
À recevoir	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	3,000	21/09/2027	15 200	(247)	(0,06)
À payer	SIBCSORA SGD composé-OIS à 1 jour	3,250	21/12/2027	8 000	72	0,02
À recevoir[3]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,500	15/03/2028	$ 3 600	53	0,01
À recevoir[3]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,500	15/03/2033	900	33	0,01
À recevoir[3]	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	2,500	15/03/2053	200	14	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	5,338	02/01/2025	BRL 14 100	(168)	(0,04)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,580	02/01/2025	10 300	(199)	(0,05)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,770	02/01/2025	3 300	(68)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,840	02/01/2025	11 400	(234)	(0,05)
À payer	CDI BRL à 1 an	5,877	02/01/2025	3 000	(61)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,620	02/01/2025	5 500	110	0,03
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,630	02/01/2025	4 900	98	0,02
À recevoir	CDI BRL à 1 an	6,840	02/01/2025	16 800	384	0,09
À recevoir	CDI BRL à 1 an	7,010	02/01/2025	7 900	174	0,04
À recevoir	CDI BRL à 1 an	7,328	02/01/2025	20 000	407	0,09
À payer	CDI BRL à 1 an	7,715	02/01/2025	7 800	(154)	(0,04)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	7,733	02/01/2025	8 200	153	0,04
À recevoir	CDI BRL à 1 an	8,180	02/01/2025	14 600	258	0,06
À payer	CDI BRL à 1 an	8,550	02/01/2025	700	(13)	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	8,730	02/01/2025	21 700	331	0,08
À recevoir	CDI BRL à 1 an	8,985	02/01/2025	10 900	153	0,04
À recevoir	CDI BRL à 1 an	9,525	02/01/2025	13 300	156	0,04
À recevoir	CDI BRL à 1 an	9,630	02/01/2025	4 500	49	0,01
À recevoir	CDI BRL à 1 an	10,295	04/01/2027	6 000	17	0,00
À payer	CDI BRL à 1 an	10,445	04/01/2027	20 100	(233)	(0,05)
À payer	CDI BRL à 1 an	10,813	02/01/2025	10 500	(68)	(0,02)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,043	04/01/2027	10 400	85	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	11,070	04/01/2027	8 900	(73)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,180	04/01/2027	17 900	(136)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,240	04/01/2027	24 300	(146)	(0,03)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,350	04/01/2027	63 000	(370)	(0,08)
À payer	CDI BRL à 1 an	11,426	04/01/2027	7 500	(43)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,451	04/01/2027	37 800	193	0,04
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,595	04/01/2027	28 200	124	0,03
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,665	04/01/2027	9 100	45	0,01
À payer	CDI BRL à 1 an	11,918	04/01/2027	28 000	(92)	(0,02)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	11,945	04/01/2027	21 800	73	0,02
À payer	CDI BRL à 1 an	12,080	04/01/2027	12 200	(31)	(0,01)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,140	04/01/2027	6 000	14	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,195	04/01/2027	25 200	28	0,01
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,455	04/01/2027	7 900	6	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,718	04/01/2027	35 400	(18)	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	12,740	04/01/2027	45 700	(44)	(0,01)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,770	04/01/2027	11 000	9	0,00
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,080	04/01/2027	47 200	(116)	(0,03)
À recevoir	CDI BRL à 1 an	13,190	04/01/2027	34 700	(102)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	13,280	04/01/2027	9 600	31	0,01
À recevoir[3]	Bon bancaire en CAD à 3 mois	3,250	15/03/2028	CAD 5 300	(1)	0,00
À recevoir[3]	Bon bancaire en CAD à 3 mois	3,250	15/03/2033	8 300	10	0,00
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,250	21/12/2027	CNY 61 900	(108)	(0,02)
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,268	16/09/2025	3 000	(5)	0,00
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,295	16/09/2025	17 900	(31)	(0,01)
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,345	16/09/2025	6 000	(10)	0,00
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	15/09/2026	14 100	13	0,00
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	15/12/2026	28 900	(41)	(0,01)
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	16/03/2027	54 900	75	0,02
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	15/06/2027	50 500	(129)	(0,03)
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	21/09/2027	149 120	(284)	(0,07)
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,500	21/12/2027	35 200	(81)	(0,02)
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,630	16/12/2025	2 400	2	0,00
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,645	16/12/2025	7 400	-7	0,00
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,645	16/12/2025	8 600	8	0,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (suite)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel		Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,663 %	17/03/2026	CNY	4 200	$ 4	0,00
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,700	17/03/2026		7 000	5	0,00
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,718	16/12/2025		2 900	(2)	0,00
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,725	16/09/2025		3 000	(2)	0,00
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,750	15/09/2026		81 800	(120)	(0,03)
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,750	21/09/2027		121 200	58	0,01
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,750	21/12/2027		482 200	15	0,00
À recevoir[3]	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,750	15/03/2028		41 900	20	0,00
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,760	17/03/2026		12 500	(8)	0,00
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,780	16/12/2025		15 900	(9)	0,00
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,790	17/03/2026		2 800	1	0,00
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,800	16/06/2026		55 700	43	0,01
À payer	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,823	17/03/2026		4 500	2	0,00
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,828	17/03/2026		4 300	(2)	0,00
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,900	17/03/2026		20 900	(27)	(0,01)
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,903	17/03/2026		5 500	(1)	0,00
À recevoir	CNREPOFIX CNY à 3 mois	2,993	17/03/2026		8 300	0	0,00
À payer[3]	CNREPOFIX CNY à 3 mois	3,000	15/03/2028		37 400	18	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,034	13/01/2026	COP	2 305 800	(99)	(0,02)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,220	11/12/2025		1 542 400	35	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,295	09/10/2025		1 638 900	(42)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,400	28/08/2025		1 571 400	37	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,850	24/04/2025		2 558 800	(67)	(0,02)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	3,940	05/03/2026		4 713 300	175	0,04
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,110	23/03/2026		6 908 300	249	0,06
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,240	16/04/2026		4 566 900	173	0,04
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,350	27/03/2025		625 600	17	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,360	30/03/2025		836 600	22	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,490	30/04/2026		3 271 600	(119)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,660	11/06/2026		1 410 500	49	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	4,880	07/05/2026		3 283 600	(111)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,150	13/03/2025		121 800	4	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	5,980	14/10/2026		4 816 400	(145)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,190	05/11/2026		9 002 000	251	0,06
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,360	19/11/2026		5 335 800	(142)	(0,03)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,410	08/11/2026		5 252 200	159	0,04
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	6,950	04/02/2027		6 498 500	153	0,04
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	7,900	08/04/2027		4 251 300	(73)	(0,02)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,494	27/05/2027		5 817 600	73	0,02
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,850	06/05/2027		6 000 000	61	0,01
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	8,970	05/08/2027		8 528 200	(78)	(0,02)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	9,160	20/05/2027		8 106 600	63	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,050	09/09/2027		8 150 200	3	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,210	18/11/2027		3 214 900	3	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,275	18/11/2027		6 380 400	8	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,390	30/09/2027		10 319 800	(21)	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,420	21/11/2027		6 380 400	16	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,430	21/11/2027		6 563 400	17	0,00
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,443	21/11/2027		19 784 200	53	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,478	29/09/2027		10 549 600	(28)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,800	31/10/2027		32 387 900	(412)	(0,09)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,810	14/10/2027		5 776 200	(32)	(0,01)
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,920	18/10/2027		2 950 700	(19)	0,00
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	10,940	18/10/2027		5 920 600	(39)	(0,01)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,424	21/10/2027		13 833 600	143	0,03
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,450	21/10/2027		4 011 800	42	0,01
À recevoir	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,800	24/10/2027		33 238 700	(372)	(0,09)
À payer	IBR COP composé-OIS à 3 mois	11,850	24/10/2027		1 323 300	18	0,00
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	0,500	17/03/2026	HKD	26 700	(359)	(0,08)
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	0,508	17/03/2026		4 700	(68)	(0,02)
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	0,550	16/12/2025		4 700	65	0,02
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	0,560	17/03/2026		3 200	(46)	(0,01)
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	0,565	16/12/2025		7 800	(109)	(0,02)
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	0,568	17/03/2026		6 300	92	0,02
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	0,583	16/12/2025		7 900	(110)	(0,03)
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	0,607	17/03/2026		9 400	138	0,03
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	0,608	17/03/2026		7 900	116	0,03
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	0,618	16/09/2025		7 800	(104)	(0,02)
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	0,670	17/03/2026		12 600	177	0,04
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	0,680	16/12/2025		3 200	(46)	(0,01)
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	0,698	16/12/2025		3 100	44	0,01
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	0,700	16/09/2025		11 100	151	0,03
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	0,750	15/09/2026		39 600	155	0,04
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	0,790	16/09/2025		4 700	(65)	(0,01)
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	0,867	17/03/2026		31 700	422	0,10
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	0,883	15/09/2026		7 800	(115)	(0,03)
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	1,000	17/03/2026		11 100	145	0,03
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	1,000	16/06/2026		43 400	(622)	(0,14)
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	1,085	16/09/2025		11 200	163	0,04
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	1,100	16/06/2026		12 700	162	0,04
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	1,120	17/06/2025		3 200	44	0,01
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	1,250	15/12/2026		48 800	215	0,05

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel		Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	1,340 %	18/03/2025	HKD	8 000	$ (109)	(0,02)
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	1,500	16/03/2027		48 910	(507)	(0,12)
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	1,600	17/06/2025		5 900	(89)	(0,02)
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	1,715	18/03/2025		10 800	(157)	(0,04)
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	1,750	16/03/2027		9 800	120	0,03
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	2,000	16/03/2027		11 500	129	0,03
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	2,750	16/03/2027		18 400	(131)	(0,03)
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	3,000	15/06/2027		5 000	(33)	(0,01)
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	3,000	21/09/2027		10 400	31	0,01
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	3,250	21/09/2027		46 600	3	0,00
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	3,500	21/09/2027		27 940	93	0,02
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	3,750	21/09/2027		40 600	63	0,01
À payer	HIBOR HKD à 3 mois	4,000	21/12/2027		88 700	60	0,01
À recevoir	HIBOR HKD à 3 mois	4,500	21/12/2027		150 900	(583)	(0,13)
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,520	26/07/2026	ILS	24 300	(739)	(0,17)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,601	05/07/2026		2 800	85	0,02
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,628	25/06/2026		5 600	(152)	(0,03)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,692	13/09/2026		48 400	1 406	0,32
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,728	04/06/2026		4 100	(112)	(0,03)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,730	21/05/2026		3 500	92	0,02
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,750	10/12/2026		34 100	(1 038)	(0,24)
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,900	07/10/2026		9 000	(255)	(0,06)
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,905	25/11/2026		8 100	(247)	(0,06)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,965	14/01/2027		10 600	291	0,07
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,040	28/10/2026		10 400	(292)	(0,07)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	1,049	12/11/2026		12 000	326	0,07
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	1,105	21/01/2027		16 900	433	0,10
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	1,178	04/02/2027		13 800	341	0,08
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	2,183	06/05/2027		7 500	99	0,02
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	2,390	27/05/2027		11 400	127	0,03
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	2,666	18/07/2027		7 500	42	0,01
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	2,670	15/07/2027		34 800	25	0,01
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	2,825	10/06/2027		10 900	(62)	(0,01)
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	3,210	17/06/2027		1 900	11	0,00
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	3,260	18/11/2027		38 400	(217)	(0,05)
À payer	TELBOR ILS à 3 mois	3,290	16/11/2027		25 363	(121)	(0,03)
À recevoir[3]	TELBOR ILS à 3 mois	3,650	02/01/2028		18 900	7	0,00
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	3,670	30/12/2027		19 000	2	0,00
À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	3,720	21/10/2027		72 900	(30)	(0,01)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	0,830	16/09/2025	KRW	950 500	(33)	(0,01)
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	0,888	16/12/2025		509 100	19	0,00
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	0,910	16/09/2025		737 100	26	0,01
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	0,994	16/12/2025		450 000	18	0,00
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	1,000	16/12/2025		907 600	(36)	(0,01)
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	1,120	17/03/2026		4 208 600	186	0,04
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	1,400	17/03/2026		5 001 700	246	0,06
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	1,500	16/06/2026		3 925 900	210	0,05
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	1,500	15/09/2026		9 830 000	88	0,02
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	1,625	15/09/2026		900 700	8	0,00
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	1,750	16/03/2027		6 778 400	214	0,05
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	2,000	15/12/2026		6 833 600	(77)	(0,02)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	2,500	16/03/2027		3 811 300	(155)	(0,04)
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	2,500	15/06/2027		123 300	2	0,00
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	2,750	15/06/2027		4 069 700	(123)	(0,03)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,000	15/06/2027		2 600 000	(52)	(0,01)
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	3,000	21/09/2027		5 600 600	(6)	0,00
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,250	21/09/2027		2 313 900	(27)	(0,01)
À payer[3]	KORIBOR KRW à 3 mois	3,500	15/03/2028		5 822 300	(56)	(0,01)
À payer	KORIBOR KRW à 3 mois	3,750	21/12/2027		10 681 300	25	0,01
À recevoir	KORIBOR KRW à 3 mois	4,000	21/12/2027		20 304 200	(388)	(0,09)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	4,900	12/11/2025	ZAR	3 400	(16)	0,00
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	4,938	18/09/2025		7 000	35	0,01
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	5,120	02/09/2025		500	3	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	5,330	13/05/2025		8 300	(44)	(0,01)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	5,375	27/05/2025		7 800	(42)	(0,01)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	5,601	09/06/2026		31 050	(131)	(0,03)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	5,680	08/06/2026		41 150	(175)	(0,04)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	5,739	28/07/2026		72 100	(298)	(0,07)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	5,780	03/03/2026		36 600	131	0,03
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	5,860	23/06/2026		75 600	285	0,07
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	5,950	17/03/2026		1 200	4	0,00
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	5,980	22/09/2026		43 900	169	0,04
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	6,023	01/07/2026		28 100	95	0,02
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	6,200	22/04/2025		7 800	(50)	(0,01)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	6,231	29/09/2026		55 400	187	0,04
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	6,300	23/12/2026		30 900	(108)	(0,02)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	6,320	23/04/2025		5 600	(37)	(0,01)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	6,400	30/12/2026		33 600	(111)	(0,03)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	6,540	04/01/2027		37 100	(110)	(0,03)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	6,540	23/02/2027		64 600	(203)	(0,05)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	6,670	12/01/2027		73 700	202	0,05
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	6,690	04/11/2026		2 000	6	0,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (suite)

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	6,835 %	28/08/2024	ZAR 100	$ 1	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	6,855	03/11/2026	22 830	(50)	(0,01)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,049	09/03/2027	70 000	151	0,03
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,489	18/05/2027	112 100	66	0,02
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,600	19/06/2024	7 100	53	0,01
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,710	06/05/2027	22 200	14	0,00
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,740	17/08/2027	63 300	(65)	(0,01)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,750	20/03/2024	9 180	(67)	(0,02)
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	7,800	19/12/2023	3 100	(21)	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	8,055	14/11/2027	8 400	4	0,00
À payer	JIBAR ZAR à 3 mois	8,064	27/07/2027	21 200	(28)	(0,01)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	8,500	17/10/2027	12 000	(14)	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,130	31/07/2025	CLP 332 000	(41)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,190	14/08/2025	6 000	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,310	23/10/2025	4 700	0	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,750	12/02/2026	901 600	181	0,04
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	1,915	09/03/2025	325 300	(43)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,280	14/02/2025	317 700	(48)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,290	09/03/2026	1 057 700	185	0,04
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	2,525	22/03/2026	755 000	110	0,03
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,170	21/06/2026	791 600	93	0,02
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,245	19/07/2026	1 399 300	217	0,05
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,570	09/07/2026	1 279 600	(185)	(0,04)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	3,728	20/08/2026	2 239 800	286	0,07
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,220	19/11/2026	2 363 300	(109)	(0,02)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,261	17/11/2027	3 774 600	(139)	(0,03)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,280	17/11/2027	3 854 600	(138)	(0,03)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,300	17/11/2027	940 100	(33)	(0,01)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,358	18/11/2027	2 390 300	(76)	(0,02)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,420	28/10/2026	1 284 200	58	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,420	18/11/2027	7 201 400	(215)	(0,05)
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,530	18/11/2027	2 406 700	(55)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,620	22/10/2026	1 673 000	59	0,01
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	5,975	18/01/2027	1 912 300	60	0,01
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,207	31/05/2027	1 836 600	10	0,00
À payer	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,230	27/05/2027	1 675 600	9	0,00
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	6,885	13/05/2027	1 642 400	(56)	(0,01)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,160	21/10/2027	5 870 000	(295)	(0,07)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,161	17/06/2027	2 386 300	(129)	(0,03)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,174	17/06/2027	1 432 400	(81)	(0,02)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,420	09/09/2027	2 595 500	(156)	(0,04)
À recevoir	CHILIBOR CLP à 6 mois	7,900	30/09/2027	2 317 200	(206)	(0,05)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	0,421	15/05/2025	CZK 900	(4)	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	0,590	26/03/2025	10 900	(55)	(0,01)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	0,637	24/07/2025	7 700	(47)	(0,01)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	0,665	22/09/2025	5 100	(30)	(0,01)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	0,690	04/05/2025	4 100	(20)	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	0,710	30/03/2025	100	(1)	0,00
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	0,776	20/08/2025	7 900	(48)	(0,01)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	1,100	31/12/2025	57 000	329	0,08
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,124	13/03/2025	12 000	(66)	(0,02)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	1,570	09/03/2026	59 800	335	0,08
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	1,580	19/03/2026	51 600	270	0,06
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,715	23/07/2026	100 200	(645)	(0,15)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	1,775	04/06/2026	57 900	(292)	(0,07)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	1,934	02/07/2026	95 200	590	0,14
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	1,972	07/07/2026	55 500	350	0,08
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	2,015	10/08/2026	132 200	740	0,17
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	3,770	11/02/2027	72 000	(172)	(0,04)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	4,300	18/03/2027	80 900	93	0,02
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,440	12/12/2027	253 100	(397)	(0,09)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,560	09/12/2027	156 700	(211)	(0,05)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,640	07/12/2027	156 700	(189)	(0,04)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	4,680	08/12/2027	156 700	(176)	(0,04)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,103	16/11/2027	240 300	(94)	(0,02)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,140	11/07/2027	58 000	(46)	(0,01)
À payer	PRIBOR CZK à 6 mois	5,175	11/07/2027	82 400	(104)	(0,02)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,185	24/05/2027	64 000	(52)	(0,01)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,285	20/05/2027	83 300	(83)	(0,02)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,538	02/09/2027	52 400	(9)	0,00
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,640	10/06/2027	3 400	(6)	0,00
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,740	03/10/2027	121 600	(85)	(0,02)
À recevoir	PRIBOR CZK à 6 mois	5,788	20/10/2027	538 000	(625)	(0,14)
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053	€ 5 300	43	0,01
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	7 400	118	0,03
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	1,085	14/08/2025	HUF 186 300	140	0,03
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,115	08/01/2026	1 131 600	(887)	(0,20)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	1,220	15/01/2026	559 700	458	0,11
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	1,230	15/01/2026	872 700	716	0,16
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,920	16/04/2026	426 000	(319)	(0,07)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	1,958	19/03/2026	1 746 000	1 294	0,30
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	1,980	09/03/2026	646 300	486	0,11

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	2,499 %	05/07/2026	HUF 78 800	$ 61	0,01
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	2,558	06/08/2026	1 156 900	914	0,21
À payer	BBR HUF à 6 mois	5,060	18/02/2027	885 100	(479)	(0,11)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	5,500	04/03/2027	627 800	310	0,07
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	6,100	11/03/2027	498 000	213	0,05
À payer	BBR HUF à 6 mois	7,480	03/06/2027	700 700	(96)	(0,02)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	7,640	13/05/2027	721 400	192	0,04
À payer	BBR HUF à 6 mois	9,625	15/08/2027	695 900	(43)	(0,01)
À payer	BBR HUF à 6 mois	9,750	22/11/2027	283 976	(43)	(0,01)
À payer	BBR HUF à 6 mois	9,800	16/11/2027	2 235 924	(337)	(0,08)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	9,900	16/12/2027	162 500	20	0,00
À payer	BBR HUF à 6 mois	10,000	18/11/2027	319 400	(41)	(0,01)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	10,050	15/12/2027	164 000	18	0,00
À payer	BBR HUF à 6 mois	10,070	18/07/2027	428 900	(62)	(0,01)
À payer	BBR HUF à 6 mois	10,100	15/07/2027	488 900	(69)	(0,02)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	10,340	15/12/2027	334 200	28	0,01
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	11,140	23/12/2027	2 021 500	61	0,01
À payer	BBR HUF à 6 mois	11,350	11/11/2027	289 300	(29)	(0,01)
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	11,524	12/09/2027	2 052 600	27	0,01
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	11,650	09/09/2027	359 200	(7)	0,00
À recevoir	BBR HUF à 6 mois	12,500	19/10/2027	4 079 400	(421)	(0,10)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	0,481	11/08/2025	PLN 3 400	(128)	(0,03)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	0,560	17/04/2025	1 900	(61)	(0,01)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	0,580	11/01/2026	8 500	(353)	(0,08)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	0,585	22/09/2025	6 000	(224)	(0,05)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	0,635	08/05/2025	1 100	(36)	(0,01)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	0,730	05/02/2026	6 500	265	0,06
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	0,890	12/02/2026	20 900	823	0,19
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	1,188	19/03/2026	17 800	613	0,14
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	1,229	09/03/2026	7 000	252	0,06
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	1,405	10/08/2026	27 100	1 040	0,24
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	1,450	05/07/2026	5 300	(217)	(0,05)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	1,465	07/06/2026	2 400	79	0,02
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	2,185	08/10/2026	8 300	(275)	(0,06)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	2,983	08/11/2026	20 100	529	0,12
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	3,525	24/12/2026	3 300	(70)	(0,02)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	3,600	27/12/2026	3 300	(68)	(0,02)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	3,739	03/01/2027	1 000	(19)	0,00
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	3,934	04/03/2027	19 200	(178)	(0,04)
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	4,219	04/02/2027	10 200	151	0,03
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	4,830	18/03/2027	2 000	15	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,179	01/04/2027	7 900	31	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	5,460	16/08/2027	1 300	(3)	0,00
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,490	12/12/2027	19 700	(134)	(0,03)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,525	12/12/2027	6 500	(42)	(0,01)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,670	09/12/2027	19 500	(100)	(0,02)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,750	08/12/2027	16 300	(71)	(0,02)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,800	07/12/2027	32 600	(128)	(0,03)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	5,830	08/12/2027	32 600	(118)	(0,03)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,310	18/11/2027	14 800	8	0,00
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,348	09/09/2027	14 800	(10)	0,00
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,365	17/11/2027	15 600	17	0,00
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	6,455	16/11/2027	23 630	45	0,01
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	6,650	29/09/2027	33 200	(280)	(0,06)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	7,223	29/06/2027	23 200	290	0,07
À recevoir	WIBOR PLN à 6 mois	7,726	24/10/2027	87 700	(1 087)	(0,25)
À payer	WIBOR PLN à 6 mois	7,761	21/10/2027	7 052	94	0,02
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	4,775	26/06/2025	MXN 4 900	28	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	4,800	05/02/2026	65 500	346	0,08
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,080	09/10/2025	14 500	(92)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,095	30/10/2025	23 500	(146)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,120	06/05/2025	15 800	(94)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	5,443	17/04/2025	5 700	(35)	(0,01)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	5,550	12/03/2026	32 800	167	0,04
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,050	04/06/2026	22 600	(103)	(0,02)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,095	20/03/2026	51 800	226	0,05
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,210	28/03/2025	4 300	(30)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,230	07/04/2025	16 700	(116)	(0,03)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,255	21/05/2026	23 500	101	0,02
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,460	18/06/2026	43 000	164	0,04
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,625	11/09/2026	21 100	82	0,02
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,635	11/09/2026	21 100	81	0,02
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	6,740	17/09/2026	28 500	104	0,02
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,109	03/12/2026	102 300	(323)	(0,07)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,113	24/09/2026	134 600	408	0,09
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,264	17/12/2026	30 000	86	0,02
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,273	12/11/2026	33 880	(96)	(0,02)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,353	05/11/2026	58 150	158	0,04
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,370	14/10/2026	24 200	(65)	(0,01)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,383	28/01/2027	29 500	81	0,02
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,460	04/02/2027	44 800	(115)	(0,03)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,530	14/01/2027	24 100	58	0,01

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,590 %	29/10/2026	MXN 40 000	$ 90	0,02
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	7,673	31/12/2026	23 900	53	0,01
À payer	TIIE MXN à 28 jours	7,745	11/02/2027	53 100	(109)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,250	02/12/2032	89 200	(148)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,280	29/07/2027	40 300	(58)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,400	21/05/2027	47 400	(43)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,402	20/05/2027	34 800	(32)	(0,01)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,453	30/11/2027	332 600	(272)	(0,06)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,480	30/11/2027	105 200	(80)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,498	11/03/2027	25 400	(18)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,616	05/11/2027	165 400	(79)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,620	09/11/2027	82 900	(10)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,740	30/08/2027	30 800	(1)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,785	06/05/2027	24 900	4	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	8,810	01/07/2027	60 100	(6)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	8,921	25/08/2027	61 100	2	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,020	03/06/2027	91 300	(34)	(0,01)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,060	14/09/2027	61 100	(31)	(0,01)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,070	24/06/2027	13 500	(5)	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,114	24/06/2027	11 700	(5)	0,00
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,290	23/09/2027	22 500	20	0,00
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,295	21/10/2027	116 100	(107)	(0,02)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	9,300	24/09/2027	34 400	31	0,01
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,382	12/10/2027	153 800	(168)	(0,04)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,390	07/10/2027	40 300	(43)	(0,01)
À recevoir	TIIE MXN à 28 jours	9,536	22/09/2027	67 800	(92)	(0,02)
					$ (663)	(0,15)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ (270)**	**(0,06)**

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,230 %	02/12/2025	ILS 2 100	$ 0	$ (58)	$ (58)	(0,01)
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,250	20/08/2025	2 100	3	50	53	0,01
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,265	29/05/2025	3 700	0	(85)	(85)	(0,02)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,270	04/11/2025	2 900	0	(79)	(79)	(0,02)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,305	15/05/2025	2 900	0	(66)	(66)	(0,02)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,330	14/02/2025	2 900	0	(59)	(59)	(0,01)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,335	29/11/2024	2 200	0	(41)	(41)	(0,01)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,361	03/02/2026	2 800	0	(78)	(78)	(0,02)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,403	31/01/2025	2 900	0	(57)	(57)	(0,01)
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,405	30/10/2024	1 500	0	28	28	0,01
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,666	06/04/2026	6 400	0	169	169	0,04
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,684	10/03/2026	7 800	0	188	188	0,04
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,712	19/03/2026	19 700	0	471	471	0,11
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,345	23/11/2023	5 900	0	(41)	(41)	(0,01)
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	2,153	17/03/2026	MYR 2 700	0	(30)	(30)	(0,01)
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	2,367	17/03/2026	5 700	0	54	54	0,01
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	2,500	15/09/2026	21 600	22	193	215	0,05
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	2,700	16/06/2026	7 800	10	(70)	(60)	(0,01)
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	2,750	15/12/2026	10 700	(8)	(83)	(91)	(0,02)
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	2,750	15/12/2026	14 000	13	106	119	0,03
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,000	16/03/2027	17 600	78	41	119	0,03
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	3,000	16/03/2027	8 200	(10)	(46)	(56)	(0,01)
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	15/06/2027	20 900	(14)	(34)	(48)	(0,01)
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	21/09/2027	15 100	28	(27)	1	0,00
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	21/12/2027	143 400	98	(110)	(12)	0,00
	À payer	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	21/12/2027	THB 124 000	27	(21)	6	0,00
	À payer	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,500	21/12/2027	353 000	144	(4)	140	0,03
	À payer	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,750	21/09/2027	76 800	(3)	59	56	0,01

Contrepartie	Taux variable à payer/à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel		Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
	À payer	THORON THB composé-OIS à 3 mois	3,000 %	21/12/2027	THB	170 700	$ 145	$ 41	$ 186	0,04
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	3,000	21/12/2027		159 900	(34)	(141)	(175)	(0,04)
	À payer	TAIBOR TWD à 3 mois	1,000	21/12/2027	TWD	249 200	(49)	(99)	(148)	(0,03)
	À payer	TAIBOR TWD à 3 mois	1,250	21/12/2027		501 700	41	(137)	(96)	(0,02)
	À recevoir	TAIBOR TWD à 3 mois	1,500	21/09/2027		355 684	3	(75)	(72)	(0,02)
	À recevoir	TAIBOR TWD à 3 mois	1,500	21/12/2027		556 800	93	(210)	(117)	(0,03)
BPS	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,200	06/03/2025	ILS	2 900	0	62	62	0,01
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,285	19/05/2025		1 500	0	(34)	(34)	(0,01)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,375	13/03/2025		1 500	0	(30)	(30)	(0,01)
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,410	18/10/2024		2 200	0	40	40	0,01
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,710	25/03/2025		3 300	0	57	57	0,01
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	1,480	30/11/2023		6 000	0	39	39	0,01
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	2,646	17/03/2026	MYR	8 800	0	65	65	0,01
CBK	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,257	11/12/2025	ILS	1 300	0	35	35	0,01
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,293	18/05/2025		3 000	0	(68)	(68)	(0,02)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,406	01/11/2024		1 500	0	(27)	(27)	(0,01)
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,413	08/11/2024		2 200	0	38	38	0,01
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,573	20/04/2026		4 800	0	(133)	(133)	(0,03)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,202	19/09/2023		10 400	0	(48)	(48)	(0,01)
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	1,373	07/09/2023		11 032	0	38	38	0,01
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	1,987	16/12/2025	MYR	1 800	0	(20)	(20)	0,00
	À payer	TAIBOR TWD à 3 mois	1,250	21/12/2027	TWD	132 800	(4)	(22)	(26)	(0,01)
CKL	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	1,060	15/02/2024	ILS	3 100	8	14	22	0,01
GLM	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,220	23/10/2025		2 900	0	(80)	(80)	(0,02)
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,233	02/12/2025		2 400	0	66	66	0,02
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,250	20/08/2025		2 200	0	56	56	0,01
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,320	15/01/2026		1 900	0	53	53	0,01
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,370	28/08/2025		1 400	0	34	34	0,01
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,393	02/01/2025		2 800	0	55	55	0,01
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,586	23/04/2026		10 400	0	(286)	(286)	(0,07)
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,635	27/03/2025		4 200	0	75	75	0,02
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,650	26/03/2025		3 300	0	58	58	0,01
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,967	19/06/2024		3 000	0	(31)	(31)	(0,01)
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	1,026	19/02/2024		2 300	0	17	17	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	2,840	16/06/2026	MYR	3 500	(5)	28	23	0,01
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	3,500	21/09/2027		48 400	188	(64)	124	0,03
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	4,000	15/06/2027		10 000	(8)	(18)	(26)	(0,01)
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	4,000	21/12/2027		39 700	131	(236)	(105)	(0,02)
GST	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	21/12/2027		86 500	103	(110)	(7)	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	4,000	21/12/2027		47 600	101	(227)	(126)	(0,03)
	À payer	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,000	21/09/2027	THB	681 770	(171)	(12)	(183)	(0,04)
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	21/09/2027		643 310	(31)	(8)	(39)	(0,01)
	À payer	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	21/12/2027		124 000	28	(22)	6	0,00
	À payer	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,500	21/09/2027		127 100	43	7	50	0,01
HUS	À payer	MIBOR INR composé-OIS à 1 jour	5,195	18/03/2025	INR	82 600	0	(28)	(28)	(0,01)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	0,350	18/09/2024	ILS	1 400	0	(23)	(23)	(0,01)
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,390	05/02/2026		10 500	0	289	289	0,07
	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	1,035	25/03/2024		3 900	1	28	29	0,01
IND	À recevoir	TAIBOR TWD à 3 mois	1,500	21/09/2027	TWD	40 670	1	(9)	(8)	0,00
JPM	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,030	19/06/2024	ILS	2 900	0	(29)	(29)	(0,01)
	À payer	TELBOR ILS à 3 mois	1,280	11/01/2024		17 620	0	(102)	(102)	(0,02)
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	3,750	21/12/2027	MYR	40 300	46	(49)	(3)	0,00
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	21/09/2027	THB	147 970	20	(29)	(9)	0,00
	À payer	TAIBOR TWD à 3 mois	1,000	21/12/2027	TWD	120 900	(27)	(45)	(72)	(0,02)
MBC	À payer	TAIBOR TWD à 3 mois	1,250	21/12/2027		390 900	31	(106)	(75)	(0,02)
MYC	À recevoir	TELBOR ILS à 3 mois	0,266	16/11/2025	ILS	1 400	(1)	39	38	0,01
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	1,975	16/12/2025	MYR	1 800	0	(20)	(20)	0,00
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	4,000	15/06/2027		6 000	(6)	(10)	(16)	0,00
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	4,250	21/12/2027		38 980	14	195	209	0,05
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	21/09/2027	THB	114 200	33	(40)	(7)	0,00
SCX	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	2,033	16/12/2025	MYR	3 500	0	38	38	0,01
	À payer	KLIBOR MYR à 3 mois	2,212	17/03/2026		2 600	0	(27)	(27)	(0,01)
	À recevoir	KLIBOR MYR à 3 mois	2,363	17/03/2026		3 000	0	28	28	0,01
	À recevoir	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	21/09/2027	THB	89 030	17	(22)	(5)	0,00
	À payer	THORON THB composé-OIS à 3 mois	2,250	21/12/2027		126 900	34	(28)	6	0,00
	À payer	TAIBOR TWD à 3 mois	1,250	21/12/2027	TWD	482 100	61	(154)	(93)	(0,02)
							$ 1 194	$ (994)	$ 200	0,04

SWAPS DE RENDEMENT TOTAL SUR INDICES

Contrepartie	À payer/à recevoir	Titre	Nbre d'actions ou de parts	Taux variable	Montant notionnel		Date d'échéance	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
MEI	À payer	Indice Brazil Stock Exchange Index	399	0,000 %	BRL	42 534	15/02/2023	$ 0	$ (341)	$ (341)	(0,08)
	À payer	Indice KOSPI2 Index	9 250 000	4,030	KRW	2 779 523	09/03/2023	0	56	56	0,01
	À recevoir	Indice SET 50 Index	284 800	0,000	THB	282 717	30/03/2023	0	120	120	0,03
								$ 0	$ (165)	$ (165)	(0,04)

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	02/2023	$	7	€	7	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
BOA	01/2023	¥	1 121 000	$	7 860	0	(641)	(641)	(0,15)
	01/2023	KRW	15 314 237		11 584	0	(589)	(589)	(0,13)
	01/2023	PEN	9 335		2 431	0	(11)	(11)	0,00
	01/2023	$	971	PLN	4 356	22	0	22	0,01
	01/2023		9 152	RON	42 863	91	0	91	0,02
	02/2023	CAD	6 117	$	4 608	93	0	93	0,02
	02/2023	€	1 831		1 952	0	(7)	(7)	0,00
	02/2023	¥	60 800		463	0	0	0	0,00
	02/2023	NOK	60		6	0	0	0	0,00
	02/2023	PEN	654		167	0	(4)	(4)	0,00
	02/2023	SEK	890		86	1	0	1	0,00
	02/2023	$	100	AUD	147	0	0	0	0,00
	02/2023		625	€	586	2	0	2	0,00
	02/2023		3 732	ZAR	64 564	48	0	48	0,01
	03/2023	ILS	347	$	102	4	0	4	0,00
	03/2023	$	4 655	€	4 375	38	(1)	37	0,01
	03/2023		8 300	IDR	129 978 000	102	0	102	0,02
	03/2023		1 997	RON	9 266	0	(7)	(7)	0,00
	03/2023		1 900	SEK	19 846	12	0	12	0,00
BPS	01/2023	BRL	2 523	$	483	5	0	5	0,00
	01/2023	CAD	7 500		5 650	114	0	114	0,03
	01/2023	THB	689 347		19 923	0	(9)	(9)	0,00
	01/2023	$	1 531	CZK	35 467	35	0	35	0,01
	01/2023		58	HUF	22 143	1	0	1	0,00
	01/2023		5 037	PHP	280 116	5	0	5	0,00
	01/2023		223	SGD	301	2	0	2	0,00
	01/2023		290	TRY	5 471	0	0	0	0,00
	02/2023		480	BRL	2 523	0	(5)	(5)	0,00
	03/2023	CAD	8 178	$	6 000	0	(39)	(39)	(0,01)
	03/2023	COP	11 842 550		2 420	9	0	9	0,00
	03/2023	INR	1 769 973		21 336	53	0	53	0,01
	03/2023	MXN	409 950		20 448	0	(322)	(322)	(0,07)
	03/2023	$	8 700	BRL	45 226	0	(245)	(245)	(0,06)
	03/2023		4 600	CHF	4 210	0	(15)	(15)	0,00
	03/2023		1 031	CLP	897 493	13	0	13	0,00
	03/2023		2 655	HUF	1 028 642	34	0	34	0,01
	03/2023		2 880	NZD	4 500	0	(32)	(32)	(0,01)
	03/2023		3 299	PEN	12 769	28	0	28	0,01
	03/2023		6 703	RON	31 255	22	(12)	10	0,00
	04/2023	CLP	210	$	0	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	CNH	50 737		7 317	0	(25)	(25)	(0,01)
	01/2023	¥	3 480 000		23 715	0	(2 699)	(2 699)	(0,62)
	01/2023	PLN	686		155	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	RON	171		37	0	0	0	0,00
	01/2023	$	2 102	BRL	10 994	0	(20)	(20)	0,00
	01/2023		70	ILS	245	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		4 609	SGD	6 208	21	0	21	0,01
	02/2023	£	393	$	480	6	0	6	0,00
	02/2023	$	212	£	175	0	(2)	(2)	0,00
	02/2023		15	SEK	155	0	0	0	0,00
	03/2023	COP	10 308 702	$	2 098	1	0	1	0,00
	03/2023	IDR	204 965		13	0	0	0	0,00
	03/2023	ILS	7 788		2 220	4	0	4	0,00
	03/2023	INR	266 797		3 204	0	(4)	(4)	0,00
CBK	01/2023	BRL	2 523		482	4	0	4	0,00
	01/2023	PLN	785		179	0	0	0	0,00
	01/2023	TRY	7 630		404	0	0	0	0,00
	01/2023	$	1 835	BRL	9 594	0	(18)	(18)	0,00
	01/2023		188	HUF	75 012	11	0	11	0,00
	01/2023		114	ILS	401	0	0	0	0,00
	01/2023		13	TRY	244	0	0	0	0,00
	02/2023	AUD	8 842	$	5 927	0	(80)	(80)	(0,02)
	02/2023	CAD	247		181	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	ILS	26 558		7 720	183	0	183	0,04
	02/2023	¥	763 200		5 707	0	(109)	(109)	(0,02)
	02/2023	SEK	2 280		221	2	0	2	0,00
	02/2023	$	15	AUD	22	0	0	0	0,00
	02/2023		479	BRL	2 523	0	(4)	(4)	0,00
	02/2023		197	¥	26 000	1	0	1	0,00

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	03/2023	COP	3 595 112	$	734	$ 2	$ 0	$ 2	0,00
	03/2023	$	3 640	CLP	3 145 957	20	(1)	19	0,00
	03/2023		110	KRW	139 040	1	0	1	0,00
	03/2023		37 454	MXN	752 620	680	0	680	0,16
	11/2023	ILS	98	$	30	1	0	1	0,00
CLY	01/2023	$	54	PLN	238	1	0	1	0,00
	02/2023		35	ZAR	608	1	0	1	0,00
	03/2023		2 597	CLP	2 356 648	143	0	143	0,03
	03/2023		5 587	PEN	21 494	12	0	12	0,00
DUB	02/2023		12	CHF	11	0	0	0	0,00
GLM	01/2023	HUF	192 916	$	501	0	(12)	(12)	0,00
	01/2023	MYR	128		29	0	0	0	0,00
	01/2023	PLN	478		108	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	THB	64 210		1 842	0	(14)	(14)	0,00
	01/2023	$	603	HUF	233 977	19	0	19	0,00
	01/2023		3 818	MYR	16 637	0	(12)	(12)	0,00
	01/2023		16	PLN	70	0	0	0	0,00
	01/2023		931	RUB	62 115	0	(79)	(79)	(0,02)
	01/2023		226	TRY	4 273	0	0	0	0,00
	02/2023	ZAR	4 845	$	280	0	(4)	(4)	0,00
	03/2023	COP	14 510 409		3 006	54	0	54	0,01
	03/2023	ILS	10 859		3 100	11	0	11	0,00
	03/2023	MXN	199 236		9 943	0	(152)	(152)	(0,03)
	03/2023	$	2 508	AUD	3 700	8	0	8	0,00
	03/2023		680	CLP	590 845	7	0	7	0,00
	03/2023		3 009	COP	14 510 409	0	(55)	(55)	(0,01)
	03/2023		4 461	£	3 625	0	(93)	(93)	(0,02)
	03/2023		1 245	HUF	481 623	13	0	13	0,00
	03/2023		2 037	MXN	40 713	26	0	26	0,01
	04/2023		30	PEN	115	0	0	0	0,00
JPM	01/2023	BRL	19 424	$	3 724	45	0	45	0,01
	01/2023	ILS	64 808		18 907	530	0	530	0,12
	01/2023	PHP	479		9	0	0	0	0,00
	01/2023	RUB	62 115		891	39	0	39	0,01
	01/2023	$	2 045	HUF	818 431	130	0	130	0,03
	01/2023		1 384	TRY	26 053	0	(3)	(3)	0,00
	02/2023	CAD	253	$	186	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	$	55	MXN	1 124	2	0	2	0,00
	02/2023		19	ZAR	326	0	0	0	0,00
	02/2023	ZAR	3 406	$	197	0	(3)	(3)	0,00
	03/2023	IDR	400 391 725		25 581	0	(301)	(301)	(0,07)
	03/2023	ILS	1 611		460	2	0	2	0,00
	03/2023	MXN	41 257		2 058	1	(34)	(33)	(0,01)
	03/2023	$	225	MXN	4 516	4	0	4	0,00
	04/2023		3 658	BRL	19 424	0	(43)	(43)	(0,01)
MBC	01/2023	CAD	298	$	222	2	0	2	0,00
	01/2023	CNH	174		25	0	0	0	0,00
	01/2023	€	1 073		1 124	0	(22)	(22)	(0,01)
	01/2023	£	916		1 116	14	0	14	0,00
	01/2023	$	106	HKD	829	0	0	0	0,00
	01/2023		87	ILS	299	0	(2)	(2)	0,00
	01/2023		20	MXN	387	0	0	0	0,00
	01/2023		9	PLN	40	0	0	0	0,00
	01/2023		423	TRY	7 975	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	AUD	718	$	483	0	(5)	(5)	0,00
	02/2023	CHF	63		69	0	0	0	0,00
	02/2023	¥	58 600		433	0	(13)	(13)	0,00
	02/2023	$	14	AUD	20	0	0	0	0,00
	02/2023		39	SEK	405	0	0	0	0,00
	03/2023	COP	2 667 859	$	585	42	0	42	0,01
	03/2023	IDR	42 168 006		2 700	0	(26)	(26)	(0,01)
	03/2023	INR	232 795		2 796	0	(3)	(3)	0,00
	03/2023	$	2 400	¥	322 475	67	0	67	0,02
	03/2023		4 200	SGD	5 648	16	0	16	0,00
MYI	01/2023	€	171	$	182	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$	317	£	263	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		77	HUF	29 158	1	0	1	0,00
	02/2023	CHF	365	$	394	0	(3)	(3)	0,00
	02/2023	SEK	8 650		851	19	0	19	0,00
	02/2023	$	178	CHF	164	0	0	0	0,00
	02/2023		187	¥	25 400	7	0	7	0,00
	02/2023		6 575	NZD	10 199	0	(121)	(121)	(0,03)
	02/2023		98	ZAR	1 709	2	0	2	0,00
	02/2023	ZAR	965	$	55	0	(2)	(2)	0,00
	03/2023	MXN	3 614		180	0	(2)	(2)	0,00
	03/2023	$	5 100	CNH	35 198	15	0	15	0,00
	03/2023		1 342	€	1 250	0	(1)	(1)	0,00
	03/2023		7	MXN	146	0	0	0	0,00
	03/2023		1 658	NZD	2 600	0	(12)	(12)	0,00
RBC	01/2023	HKD	9 279	$	1 192	3	0	3	0,00
	01/2023	$	539	HKD	4 195	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		9	KRW	11 595	0	0	0	0,00

Tableau des investissements Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
	01/2023	$	177	SGD	240	$ 2	$ 0	$ 2	0,00
	02/2023	CAD	184	$	135	0	(1)	(1)	0,00
	02/2023	$	21	AUD	31	0	0	0	0,00
	02/2023		2 346	£	1 888	0	(72)	(72)	(0,02)
	03/2023	MXN	5	$	0	0	0	0	0,00
RYL	01/2023	$	57	SGD	77	0	0	0	0,00
	02/2023		5 260	CHF	4 837	0	(7)	(7)	0,00
	03/2023	INR	333 865	$	4 000	0	(14)	(14)	0,00
SCX	01/2023	$	271	TRY	5 125	1	0	1	0,00
	02/2023	AUD	2 973	$	2 046	26	0	26	0,01
	02/2023	CHF	105		114	0	0	0	0,00
	02/2023	$	23	CHF	21	0	0	0	0,00
	02/2023		105	€	98	0	0	0	0,00
	02/2023		43	¥	5 900	2	0	2	0,00
	02/2023		37	ZAR	635	0	0	0	0,00
	03/2023	CLP	36 535	$	41	0	(2)	(2)	0,00
	03/2023	$	1 010	CLP	874 432	7	0	7	0,00
	03/2023		3 300	HUF	1 327 567	169	0	169	0,04
	03/2023		15 390	KRW	19 462 194	101	0	101	0,02
	03/2023		9 427	PEN	36 306	36	0	36	0,01
	03/2023		3 600	THB	123 190	0	(19)	(19)	0,00
SOG	01/2023		736	BRL	3 883	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023		169	SGD	229	2	0	2	0,00
	02/2023	CAD	734	$	542	0	0	0	0,00
SSB	03/2023	$	4 991	CLP	4 324 364	38	0	38	0,01
TOR	01/2023	CAD	2 400	$	1 750	0	(21)	(21)	0,00
	01/2023	CZK	1 002		44	0	0	0	0,00
	01/2023	¥	2 344 000		16 044	0	(1 767)	(1 767)	(0,40)
	01/2023	$	88	CZK	2 036	2	0	2	0,00
	02/2023	CAD	6 200	$	4 624	65	(18)	47	0,01
	02/2023	$	13	CAD	18	0	0	0	0,00
	02/2023		61	ZAR	1 054	0	0	0	0,00
	03/2023	ILS	3 296	$	940	2	0	2	0,00
UAG	01/2023		3 019		881	25	0	25	0,01
	01/2023	$	174	CZK	4 001	3	0	3	0,00
	01/2023		7	HKD	56	0	0	0	0,00
	02/2023	€	3 241	$	3 469	0	0	0	0,00
	02/2023	¥	1 590 000		11 313	0	(813)	(813)	(0,19)
	02/2023	$	23	SEK	240	0	0	0	0,00
	02/2023		13	ZAR	231	0	0	0	0,00
	03/2023	ILS	6 936	$	1 980	7	0	7	0,00
	03/2023	$	2 300	CZK	52 642	17	0	17	0,00
						$ 3 412	$ (8 662)	$ (5 250)	(1,20)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$	2 869	€	2 721	$ 36	$ 0	$ 36	0,01
BPS	01/2023		206		193	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	€	2 544	$	2 703	0	(12)	(12)	0,00
	01/2023	$	48 028	€	46 237	1 340	0	1 340	0,31
MBC	01/2023	€	1 992	$	2 111	0	(15)	(15)	(0,01)
	01/2023	$	53 062	€	50 589	952	0	952	0,22
RYL	01/2023	€	10	$	11	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	$	45 082	€	43 312	1 163	0	1 163	0,27
						$ 3 491	$ (27)	$ 3 464	0,80

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BRC	01/2023	£	5	$	6	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$	12 683	£	10 517	0	(30)	(30)	(0,01)
CBK	01/2023		12 684		10 517	0	(30)	(30)	(0,01)
SCX	01/2023	£	263	$	316	0	0	0	0,00
	01/2023	$	12 677	£	10 518	2	(25)	(23)	0,00
						$ 2	$ (85)	$ (83)	(0,02)

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ (1 834)**	**(0,42)**

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CERTIFICATS DE DÉPÔT			
Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd.			
4,780 % éch. 28/02/2023	$ 600	$ 600	0,14
Total des Certificats de dépôt		**$ 600**	**0,14**
Total des Investissements		**$ 404 071**	**92,69**
Autres actifs et passifs à court terme		**$ 31 853**	**7,31**
Actif net		**$ 435 924**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* **Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

(a) **Titre à coupon zéro.**

(b) **Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.**

(c) **Affilié au Fonds.**

(d) **Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : néant) :**

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Deutsche Bank AG	0,898 %	28/05/2024	31/03/2022	$ 970	$ 936	0,21

Un montant en numéraire de 21 987 $ (31 décembre 2021 : 8 489 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un titre d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 281 $) et un montant en numéraire de 6 601 $ (31 décembre 2021 : 260 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 335 879	$ 0	$ 335 879
Fonds d'investissement	10 879	30 814	0	41 693
Contrats de mise en pension	0	27 452	0	27 452
Instruments financiers dérivés[3]	467	(2 020)	0	(1 553)
Dépôts auprès d'établissements de crédit	0	600	0	600
Totaux	**$ 11 346**	**$ 392 725**	**$ 0**	**$ 404 071**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 87 130	$ 0	$ 87 130
Fonds d'investissement	4 572	0	0	4 572
Contrats de mise en pension	0	800	0	800
Instruments financiers dérivés[3]	315	4 571	0	4 886
Totaux	**$ 4 887**	**$ 92 501**	**$ 0**	**$ 97 388**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ (475)	$ 490	$ 15	$ 272	$ (280)	$ (8)
BPS	(159)	380	221	(424)	260	(164)
BRC	(2 750)	2 340	(410)	(60)	0	(60)
CBK	1 779	(2 180)	(401)	(159)	0	(159)
CKL	22	0	22	(24)	0	(24)
CLY	157	0	157	S/O	S/O	S/O
DUB	S/O	S/O	S/O	1	0	1

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
FBF	$ S/O	$ S/O	$ S/O	$ 17	$ 0	$ 17
GLM	(251)	330	79	(377)	281	(96)
GST	(299)	261	(38)	S/O	S/O	S/O
HUS	267	(260)	7	(51)	0	(51)
IND	(8)	0	(8)	399	(290)	109
JPM	153	(390)	(237)	112	(180)	(68)
MBC	931	(880)	51	S/O	S/O	S/O
MEI	(165)	450	285	94	0	94
MYC	204	0	204	37	0	37
MYI	(99)	120	21	(9)	0	(9)
RBC	(69)	50	(19)	58	0	58
RYL	(21)	0	(21)	2	0	2
SCX	1 408	(1 310)	98	91	0	91
SOG	1	0	1	1	0	1
SSB	38	0	38	S/O	S/O	S/O
TOR	(1 737)	1 620	(117)	(110)	0	(110)
UAG	(761)	560	(201)	(70)	0	(70)

[1] L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	28,54	14,64
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	48,50	70,97
Fonds d'investissement	9,56	4,49
Contrats de mise en pension	6,30	0,79
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,13	0,30
Instruments financiers dérivés compensés	(0,06)	4,69
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,42)	(0,20)
Certificats de dépôt	0,14	S/O

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Obligations et billets privés	39,15	10,28
Obligations et billets municipaux	0,23	0,49
Agences du gouvernement américain	1,39	2,50
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	0,45	1,97
Titres adossés à des actifs	1,06	2,47
Émissions souveraines	0,53	0,49
Instruments à court terme	34,23	67,41
Fonds d'investissement	9,56	4,49
Contrats de mise en pension	6,30	0,79
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,13	0,30
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection	S/O	(0,05)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,09	0,01
Swaps de taux d'intérêt	(0,15)	4,73
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Options de change	S/O	0,00
Swaps de taux d'intérêt	0,04	0,13
Swaps de rendement total sur indices	(0,04)	0,09
Contrats de change à terme	(1,20)	(0,55)
Contrats de change à terme couverts	0,78	0,13
Certificats de dépôt	0,14	S/O
Autres actifs et passifs à court terme	7,31	4,32
Actif net	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES					
AUTRICHE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Erste Group Bank AG					
6,500 % éch. 15/04/2024 (d)(f)	€	200	£	174	0,05
BELGIQUE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Sofina S.A.					
1,000 % éch. 23/09/2028		400		277	0,07
CANADA					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Canadian Imperial Bank of Commerce					
4,403 % éch. 15/12/2025	£	750		758	0,20
ÎLES CAÏMANS					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Trafford Centre Finance Ltd.					
4,750 % éch. 28/04/2029		500		470	0,12
DANEMARK					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Orsted A/S					
2,500 % éch. 16/05/2033		1 500		1 187	0,30
5,125 % éch. 13/09/2034		1 400		1 382	0,36
TDC Net A/S					
5,056 % éch. 31/05/2028	€	700		612	0,16
Total Danemark				3 181	0,82
FRANCE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
AXA S.A.					
5,453 % éch. 04/03/2026 (d)	£	850		830	0,21
Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A.					
4,875 % éch. 25/09/2025		1 200		1 189	0,31
BNP Paribas S.A.					
1,250 % éch. 13/07/2031		500		355	0,09
2,000 % éch. 13/09/2036		800		530	0,14
2,875 % éch. 24/02/2029		1 700		1 448	0,37
4,625 % éch. 25/02/2031 (d)(f)	$	900		580	0,15
7,750 % éch. 16/08/2029 (d)(f)		700		576	0,15
Crédit Agricole S.A.					
5,750 % éch. 29/11/2027	£	1 400		1 395	0,36
7,500 % éch. 23/06/2026 (d)(f)		750		730	0,19
Électricité de France S.A.					
5,125 % éch. 22/09/2050		1 050		922	0,24
5,500 % éch. 27/03/2037		2 000		1 898	0,49
5,500 % éch. 17/10/2041		1 000		935	0,24
6,125 % éch. 02/06/2034		400		403	0,10
JCDecaux SE					
1,625 % éch. 07/02/2030	€	200		142	0,04
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE					
1,125 % éch. 11/02/2027	£	1 400		1 224	0,31
Société Générale S.A.					
7,375 % éch. 04/10/2023 (d)(f)	$	200		159	0,04
7,875 % éch. 18/12/2023 (d)(f)		400		330	0,08
Total France				13 646	3,51
ALLEMAGNE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Commerzbank AG					
8,625 % éch. 28/02/2033	£	900		905	0,23
Deutsche Bahn Finance GmbH					
1,875 % éch. 13/02/2026		500		464	0,12
Deutsche Bank AG					
1,375 % éch. 17/02/2032	€	900		583	0,15
1,875 % éch. 22/12/2028	£	2 900		2 310	0,59
DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH					
2,500 % éch. 25/01/2027	€	600		399	0,10
Hamburg Commercial Bank AG					
6,250 % éch. 18/11/2024		1 100		989	0,25
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % en numéraire ou 4,500 % de rémunération en nature)					
3,750 % éch. 15/09/2026 (a)	€	200	£	155	0,04
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau					
0,875 % éch. 15/09/2026	£	900		795	0,20
1,125 % éch. 04/07/2025		700		648	0,17
5,750 % éch. 07/06/2032		400		449	0,12
Schaeffler AG					
2,750 % éch. 12/10/2025	€	400		339	0,09
				8 036	2,06
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
État de Saxe-Anhalt					
2,125 % éch. 16/12/2024	£	600		574	0,15
Total Allemagne				8 610	2,21
IRLANDE					
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS					
Toro European CLO DAC					
2,239 % éch. 12/01/2032	€	3 600		3 077	0,79
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Bank of Ireland Group PLC					
6,750 % éch. 01/03/2033		100		88	0,02
GE Capital UK Funding Unlimited Co.					
5,875 % éch. 18/01/2033	£	1 500		1 527	0,39
Perrigo Finance Unlimited Co.					
4,400 % éch. 15/06/2030	$	200		142	0,04
				1 757	0,45
Total Irlande				4 834	1,24
ITALIE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Aeroporti di Roma SpA					
5,441 % éch. 20/02/2023	£	550		549	0,14
Intesa Sanpaolo SpA					
5,148 % éch. 10/06/2030		600		490	0,13
Nexi SpA					
1,625 % éch. 30/04/2026	€	160		130	0,03
2,125 % éch. 30/04/2029		300		217	0,06
UniCredit SpA					
7,830 % éch. 04/12/2023	$	1 000		840	0,21
Total Italie				2 226	0,57
JAPON					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
East Japan Railway Co.					
1,162 % éch. 15/09/2028	£	1 500		1 211	0,31
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
AA Bond Co. Ltd.					
4,875 % éch. 31/07/2043		2 500		2 370	0,61
Gatwick Funding Ltd.					
2,500 % éch. 15/04/2032		600		481	0,12
Heathrow Funding Ltd.					
2,750 % éch. 13/10/2031		1 000		828	0,21
2,750 % éch. 09/08/2051		1 100		651	0,17
4,625 % éch. 31/10/2046		1 100		906	0,23
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP					
5,844 % éch. 05/11/2031 (d)		1 400		1 433	0,37
Total Jersey, Îles Anglo-normandes				6 669	1,71
LUXEMBOURG					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Aroundtown S.A.					
3,625 % éch. 10/04/2031		800		487	0,12
Bevco Lux SARL					
1,000 % éch. 16/01/2030	€	1 300		869	0,22
CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.					
2,000 % éch. 17/10/2027	£	450		383	0,10
CPI Property Group S.A.					
2,750 % éch. 22/01/2028		1 150		770	0,20
Logicor Financing SARL					
2,750 % éch. 15/01/2030	£	1 800	£	1 373	0,35
Prologis International Funding S.A.					
2,750 % éch. 22/02/2032		900		723	0,19
Total Luxembourg				4 605	1,18
PAYS-BAS					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
ABN AMRO Bank NV					
4,375 % éch. 22/09/2025 (d)(f)	€	1 000		820	0,21
Cooperatieve Rabobank UA					
1,250 % éch. 14/01/2025	£	300		277	0,07
1,875 % éch. 12/07/2028		800		679	0,18
3,100 % éch. 29/06/2028 (d)(f)	€	400		275	0,07
4,375 % éch. 29/06/2027 (d)(f)		800		634	0,16
4,625 % éch. 23/05/2029	£	1 500		1 371	0,35
5,250 % éch. 14/09/2027		600		580	0,15
CTP NV					
0,875 % éch. 20/01/2026	€	700		506	0,13
E.ON International Finance BV					
4,750 % éch. 31/01/2034	£	2 000		1 845	0,47
5,875 % éch. 30/10/2037		1 100		1 106	0,28
6,125 % éch. 06/07/2039		700		720	0,19
6,250 % éch. 03/06/2030		250		261	0,07
6,375 % éch. 07/06/2032		600		636	0,16
Enel Finance International NV					
2,875 % éch. 11/04/2029		1 300		1 115	0,29
5,000 % éch. 15/06/2032	$	1 000		751	0,19
5,750 % éch. 14/09/2040	£	1 400		1 365	0,35
7,500 % éch. 14/10/2032	$	200		176	0,05
Holcim Sterling Finance Netherlands BV					
2,250 % éch. 04/04/2034	£	1 300		893	0,23
ING Groep NV					
1,125 % éch. 07/12/2028		1 500		1 203	0,31
JAB Holdings BV					
2,250 % éch. 19/12/2039	€	600		364	0,09
JDE Peet's NV					
0,500 % éch. 16/01/2029		600		426	0,11
NE Property BV					
3,375 % éch. 14/07/2027		800		616	0,16
NN Group NV					
4,500 % éch. 15/01/2026 (d)		300		260	0,07
5,250 % éch. 01/03/2043		200		165	0,04
Sagax Euro MTN NL BV					
0,750 % éch. 26/01/2028		400		267	0,07
Toyota Motor Finance Netherlands BV					
4,625 % éch. 08/06/2026	£	700		693	0,18
Universal Music Group NV					
3,750 % éch. 30/06/2032	€	200		169	0,04
Volkswagen Financial Services NV					
0,875 % éch. 20/02/2025	£	400		362	0,09
1,125 % éch. 18/09/2023		200		195	0,05
2,125 % éch. 18/01/2028		2 700		2 244	0,58
				20 974	5,39
ÉMISSIONS SOUVERAINES					
Nederlandse Waterschapsbank NV					
5,375 % éch. 07/06/2032		1 000		1 081	0,28
Total Pays-Bas				22 055	5,67
NORVÈGE					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
DNB Bank ASA					
2,625 % éch. 10/06/2026		700		660	0,17
Equinor ASA					
4,250 % éch. 10/04/2041		1 100		979	0,25
Total Norvège				1 639	0,42
SINGAPOUR					
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS					
Temasek Financial Ltd.					
5,125 % éch. 26/07/2040		770		784	0,20

Tableau des investissements Fonds UK Corporate Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ESPAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Abertis Infraestructuras S.A.				
3,375 % éch. 27/11/2026	£	700	£ 635	0,16
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
5,875 % éch. 24/09/2023 (d)(f)	€	400	342	0,09
Banco Santander S.A.				
1,500 % éch. 14/04/2026	£	700	611	0,16
4,375 % éch. 14/01/2026 (d)(f)	€	600	454	0,12
CaixaBank S.A.				
1,500 % éch. 03/12/2026	£	1 300	1 136	0,29
3,500 % éch. 06/04/2028		900	800	0,21
5,875 % éch. 09/10/2027 (d)(f)	€	400	326	0,08
Total Espagne			4 304	1,11
SUPRANATIONALES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banque européenne d'investissement				
0,750 % éch. 15/11/2024	£	1 700	1 597	0,41
3,750 % éch. 07/12/2027		1 350	1 320	0,34
4,500 % éch. 07/06/2029		1 000	1 015	0,26
5,625 % éch. 07/06/2032		1 000	1 114	0,29
6,000 % éch. 07/12/2028		800	874	0,22
Banque internationale pour la reconstruction et le développement				
1,250 % éch. 13/12/2028		1 100	931	0,24
5,750 % éch. 07/06/2032		2 400	2 683	0,69
Association internationale de développement				
0,750 % éch. 21/09/2028		1 100	903	0,23
1,750 % éch. 05/05/2037	€	500	372	0,10
Société financière internationale				
0,750 % éch. 22/07/2027	£	1 500	1 285	0,33
Total Supranationales			12 094	3,11
SUÈDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
EQT AB				
0,875 % éch. 14/05/2031	€	200	123	0,03
2,875 % éch. 06/04/2032		600	432	0,11
Investor AB				
5,500 % éch. 05/05/2037	£	1 100	1 156	0,30
Total Suède			1 711	0,44
SUISSE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Credit Suisse Group AG				
6,250 % éch. 18/12/2024 (d)(f)	$	200	131	0,03
7,375 % éch. 07/09/2033	£	2 500	2 282	0,59
UBS AG				
5,125 % éch. 15/05/2024 (f)	$	500	411	0,11
UBS Group AG				
4,375 % éch. 10/02/2031 (d)(f)		500	317	0,08
5,125 % éch. 29/07/2026 (d)(f)		400	312	0,08
Total Suisse			3 453	0,89
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
3i Group PLC				
3,750 % éch. 05/06/2040	£	750	549	0,14
Anglian Water Services Financing PLC				
2,750 % éch. 26/10/2029		800	693	0,18
Annington Funding PLC				
2,308 % éch. 06/10/2032		1 800	1 297	0,33
3,935 % éch. 12/07/2047		900	648	0,17
Arqiva Financing PLC				
5,340 % éch. 30/12/2037		550	521	0,13
Assura Financing PLC				
1,625 % éch. 30/06/2033		1 000	669	0,17
Aviva PLC				
5,125 % éch. 04/06/2050		200	181	0,05
6,875 % éch. 20/05/2058		900	928	0,24
Barclays PLC				
1,700 % éch. 03/11/2026		800	710	0,18
3,250 % éch. 12/02/2027		200	180	0,05
3,250 % éch. 17/01/2033		2 600	2 034	0,52
4,972 % éch. 16/05/2029	$	200	156	0,04
6,375 % éch. 15/12/2025 (d)(f)	£	200	£ 184	0,05
7,250 % éch. 15/03/2023 (d)(f)		600	595	0,15
7,750 % éch. 15/09/2023 (d)(f)	$	800	651	0,17
8,407 % éch. 14/11/2032	£	600	620	0,16
8,875 % éch. 15/09/2027 (d)(f)		400	395	0,10
Berkeley Group PLC				
2,500 % éch. 11/08/2031		1 200	805	0,21
Beyond Housing Ltd.				
2,125 % éch. 17/05/2051		500	277	0,07
BG Energy Capital PLC				
5,000 % éch. 04/11/2036		300	291	0,07
Blend Funding PLC				
3,459 % éch. 21/09/2049		800	598	0,15
BPHA Finance PLC				
4,816 % éch. 11/04/2044		300	280	0,07
British Land Co. PLC				
2,375 % éch. 14/09/2029		2 000	1 579	0,41
British Telecommunications PLC				
3,125 % éch. 21/11/2031		800	668	0,17
Cadent Finance PLC				
2,625 % éch. 22/09/2038		950	646	0,17
2,750 % éch. 22/09/2046		700	432	0,11
Chanel Ceres PLC				
0,500 % éch. 31/07/2026	€	600	480	0,12
Clarion Funding PLC				
1,875 % éch. 22/01/2035	£	1 500	1 021	0,26
1,875 % éch. 07/09/2051		1 400	680	0,17
3,125 % éch. 19/04/2048		300	202	0,05
Compass Group PLC				
4,375 % éch. 08/09/2032		1 100	1 057	0,27
Derwent London PLC				
1,875 % éch. 17/11/2031		900	636	0,16
Direct Line Insurance Group PLC				
4,000 % éch. 05/06/2032		800	629	0,16
Eastern Power Networks PLC				
2,125 % éch. 25/11/2033		819	611	0,16
EMH Treasury PLC				
4,500 % éch. 29/01/2044		300	268	0,07
ENW Finance PLC				
1,415 % éch. 30/07/2030		400	305	0,08
Ferguson Finance PLC				
3,250 % éch. 02/06/2030	$	200	141	0,04
GlaxoSmithKline Capital PLC				
1,625 % éch. 12/05/2035	£	2 100	1 476	0,38
Grainger PLC				
3,000 % éch. 03/07/2030		1 085	816	0,21
Greene King Finance PLC				
3,593 % éch. 15/03/2035		369	307	0,08
4,064 % éch. 15/03/2035		210	178	0,05
5,106 % éch. 15/03/2034		552	487	0,12
5,318 % éch. 15/09/2031		1 415	1 315	0,34
GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC				
2,875 % éch. 29/10/2028		1 197	1 073	0,28
3,375 % éch. 29/03/2038		1 100	874	0,22
HSBC Holdings PLC				
1,750 % éch. 24/07/2027		1 000	861	0,22
2,625 % éch. 16/08/2028		1 400	1 190	0,31
3,000 % éch. 22/07/2028		1 100	959	0,25
3,000 % éch. 29/05/2030		1 700	1 414	0,36
4,000 % éch. 09/03/2026 (d)(f)	$	200	144	0,04
4,600 % éch. 17/12/2030 (d)(f)		500	324	0,08
5,875 % éch. 28/09/2026 (d)(f)	£	900	805	0,21
6,000 % éch. 29/09/2023 (d)(f)	€	200	176	0,05
6,000 % éch. 22/05/2027 (d)(f)	$	600	459	0,12
6,000 % éch. 29/03/2040	£	978	896	0,23
Hyde Housing Association Ltd.				
5,125 % éch. 23/07/2040		800	783	0,20
Informa PLC				
3,125 % éch. 05/07/2026		1 345	1 216	0,31
InterContinental Hotels Group PLC				
2,125 % éch. 24/08/2026		1 000	871	0,22
3,375 % éch. 08/10/2028		400	346	0,09
John Lewis PLC				
4,250 % éch. 18/12/2034		1 344	818	0,21
6,125 % éch. 21/01/2025		400	385	0,10
Karbon Homes Ltd.				
3,375 % éch. 15/11/2047		400	301	0,08
Land Securities Capital Markets PLC				
2,399 % éch. 08/02/2031	£	1 251	£ 1 083	0,28
LCR Finance PLC				
4,500 % éch. 07/12/2038		1 400	1 402	0,36
Legal & General Group PLC				
5,375 % éch. 27/10/2045		1 200	1 170	0,30
5,625 % éch. 24/03/2031 (d)(f)		850	734	0,19
Lloyds Banking Group PLC				
2,000 % éch. 12/04/2028		1 200	1 021	0,26
3,574 % éch. 07/11/2028	$	800	599	0,15
4,947 % éch. 27/06/2025 (d)(f)	€	400	341	0,09
London & Quadrant Housing Trust				
2,000 % éch. 20/10/2038	£	1 250	779	0,20
London Power Networks PLC				
5,125 % éch. 31/03/2023		150	150	0,04
M&G PLC				
5,625 % éch. 20/10/2051		400	365	0,09
Manchester Airport Group Funding PLC				
2,875 % éch. 31/03/2039		235	164	0,04
2,875 % éch. 30/09/2044		900	577	0,15
4,750 % éch. 31/03/2034		400	367	0,09
Marks & Spencer PLC				
3,750 % éch. 19/05/2026		500	437	0,11
Metropolitan Housing Trust Ltd.				
1,875 % éch. 28/07/2036		1 800	1 184	0,30
Mitchells & Butlers Finance PLC				
5,219 % éch. 15/12/2030	$	1 258	970	0,25
5,965 % éch. 15/12/2025	£	79	78	0,02
6,013 % éch. 15/12/2030		432	404	0,10
Morhomes PLC				
3,400 % éch. 19/02/2040		1 100	855	0,22
Motability Operations Group PLC				
2,125 % éch. 18/01/2042		1 800	1 189	0,31
3,625 % éch. 10/03/2036		1 250	1 100	0,28
5,625 % éch. 29/11/2030		100	106	0,03
National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC				
1,750 % éch. 09/09/2031		400	300	0,08
6,250 % éch. 10/12/2040		300	317	0,08
National Grid Electricity Distribution South Wales PLC				
5,750 % éch. 23/03/2040		850	852	0,22
National Grid Electricity Distribution West Midlands PLC				
5,750 % éch. 16/04/2032		1 600	1 620	0,42
National Grid Electricity Transmission PLC				
1,125 % éch. 07/07/2028		1 400	1 116	0,29
2,750 % éch. 06/02/2035		900	675	0,17
National Grid Gas PLC				
1,375 % éch. 07/02/2031		800	585	0,15
Nationwide Building Society				
5,875 % éch. 20/12/2024 (d)(f)		900	852	0,22
6,178 % éch. 07/12/2027		1 200	1 204	0,31
NatWest Group PLC				
2,057 % éch. 09/11/2028		1 800	1 503	0,39
2,875 % éch. 19/09/2026		500	459	0,12
3,125 % éch. 28/03/2027		500	456	0,12
3,619 % éch. 29/03/2029		600	525	0,13
5,076 % éch. 27/01/2030	$	400	314	0,08
5,125 % éch. 12/05/2027 (d)(f)	£	1 100	927	0,24
7,416 % éch. 06/06/2033		600	605	0,16
NatWest Markets PLC				
6,375 % éch. 08/11/2027		1 300	1 332	0,34
Network Rail Infrastructure Finance PLC				
4,750 % éch. 29/11/2035		1 800	1 839	0,47
NIE Finance PLC				
5,875 % éch. 01/12/2032		1 100	1 135	0,29
Northern Gas Networks Finance PLC				
4,875 % éch. 15/11/2035		250	231	0,06
5,625 % éch. 23/03/2040		50	48	0,01
Northern Powergrid Yorkshire PLC				
4,375 % éch. 05/07/2032		300	282	0,07
5,125 % éch. 04/05/2035		200	195	0,05
Northumbrian Water Finance PLC				
5,625 % éch. 29/04/2033		750	755	0,19
6,375 % éch. 28/10/2034		950	1 012	0,26
Notting Hill Genesis				
2,000 % éch. 03/06/2036		700	467	0,12
2,875 % éch. 31/01/2029		900	785	0,20
3,250 % éch. 12/10/2048		1 000	683	0,18

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
3,750 % éch. 20/12/2032	£	300	£ 264	0,07
Pacific Quay Finance PLC				
5,565 % éch. 25/07/2034		157	160	0,04
Paragon Treasury PLC				
2,000 % éch. 07/05/2036		500	341	0,09
Peabody Capital PLC				
3,250 % éch. 14/09/2048		900	620	0,16
Pearson Funding PLC				
3,750 % éch. 04/06/2030		500	443	0,11
Places for People Homes Ltd.				
3,625 % éch. 22/11/2028		900	814	0,21
Places for People Treasury PLC				
2,500 % éch. 26/01/2036		800	558	0,14
Platform HG Financing PLC				
1,926 % éch. 15/09/2041		900	557	0,14
Prudential PLC				
6,125 % éch. 19/12/2031		580	576	0,15
Quadgas Finance PLC				
3,375 % éch. 17/09/2029		800	649	0,17
Rentokil Initial PLC				
5,000 % éch. 27/06/2032		900	850	0,22
RHP Finance PLC				
3,250 % éch. 05/02/2048		350	255	0,07
Riverside Finance PLC				
3,875 % éch. 05/12/2044		900	741	0,19
Sage Group PLC				
1,625 % éch. 25/02/2031		800	598	0,15
2,875 % éch. 08/02/2034		1 500	1 157	0,30
Santander UK Group Holdings PLC				
2,421 % éch. 17/01/2029		1 100	909	0,23
3,625 % éch. 14/01/2026		600	559	0,14
4,750 % éch. 15/09/2025	$	300	238	0,06
7,098 % éch. 16/11/2027	£	500	508	0,13
Scotland Gas Networks PLC				
4,875 % éch. 21/12/2034		300	277	0,07
Scottish Hydro Electric Transmission PLC				
2,125 % éch. 24/03/2036		750	515	0,13
2,250 % éch. 27/09/2035		1 900	1 343	0,34
Severn Trent Utilities Finance PLC				
2,000 % éch. 02/06/2040		600	377	0,10
2,625 % éch. 22/02/2033		1 000	799	0,21
4,625 % éch. 30/11/2034		400	376	0,10
4,875 % éch. 24/01/2042		800	754	0,19
Society of Lloyd's				
4,875 % éch. 07/02/2047		500	466	0,12
South Eastern Power Networks PLC				
1,750 % éch. 30/09/2034		3 100	2 165	0,56
Southern Electric Power Distribution PLC				
5,500 % éch. 07/06/2032		800	810	0,21
Southern Gas Networks PLC				
3,100 % éch. 15/09/2036		1 600	1 203	0,31
Southern Housing Group Ltd.				
2,375 % éch. 08/10/2036		1 900	1 339	0,34
Sovereign Housing Capital PLC				
2,375 % éch. 04/11/2048		1 000	606	0,16
Standard Chartered PLC				
0,800 % éch. 17/11/2029	€	1 100	777	0,20
1,456 % éch. 14/01/2027	$	400	289	0,07
7,767 % éch. 16/11/2028		1 300	1 147	0,29
Student Finance PLC				
2,666 % éch. 30/09/2029	£	400	379	0,10
Telereal Securitisation PLC				
4,974 % éch. 10/12/2033		150	148	0,04
Tesco Corporate Treasury Services PLC				
1,875 % éch. 02/11/2028		1 000	817	0,21
Tesco Property Finance PLC				
5,411 % éch. 13/07/2044		640	577	0,15
5,661 % éch. 13/10/2041		278	257	0,07
5,744 % éch. 13/04/2040		1 074	1 005	0,26
5,801 % éch. 13/10/2040		187	176	0,05
Thames Water Utilities Finance PLC				
2,375 % éch. 22/04/2040		800	497	0,13
2,625 % éch. 24/01/2032		1 200	951	0,24
3,500 % éch. 25/02/2028		1 300	1 182	0,30
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % éch. 18/11/2028		1 650	1 216	0,31
5,250 % éch. 29/05/2026	£	450	£ 417	0,11
Travis Perkins PLC				
3,750 % éch. 17/02/2026		300	266	0,07
Unique Pub Finance Co. PLC				
5,659 % éch. 30/06/2027		1 001	988	0,25
7,395 % éch. 28/03/2024		264	263	0,07
UNITE Group PLC				
3,500 % éch. 15/10/2028		1 400	1 187	0,30
United Utilities Water Finance PLC				
2,000 % éch. 03/07/2033		500	377	0,10
Virgin Money UK PLC				
3,125 % éch. 22/06/2025		200	189	0,05
3,375 % éch. 24/04/2026		250	231	0,06
4,000 % éch. 25/09/2026		2 350	2 183	0,56
4,000 % éch. 03/09/2027		615	556	0,14
5,125 % éch. 11/12/2030		300	278	0,07
7,875 % éch. 14/12/2028		400	400	0,10
Vodafone Group PLC				
3,000 % éch. 12/08/2056		800	489	0,13
3,375 % éch. 08/08/2049		1 700	1 168	0,30
Wellcome Trust Ltd.				
1,500 % éch. 14/07/2071		1 300	568	0,15
Workspace Group PLC				
2,250 % éch. 11/03/2028		1 000	746	0,19
Yorkshire Building Society				
1,500 % éch. 15/09/2029		800	620	0,16
Yorkshire Water Finance PLC				
1,750 % éch. 27/10/2032		649	471	0,12
3,625 % éch. 01/08/2029		500	456	0,12
			120 338	30,92
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Alba PLC				
3,692 % éch. 15/12/2038		881	820	0,21
Atlas Funding PLC				
3,894 % éch. 25/07/2058		981	973	0,25
Avon Finance PLC				
4,331 % éch. 20/09/2048		1 574	1 544	0,40
Barley Hill PLC				
4,352 % éch. 27/08/2058		861	852	0,22
Brants Bridge PLC				
4,637 % éch. 12/12/2064		307	305	0,08
Canada Square Funding PLC				
4,375 % éch. 17/06/2058		75	74	0,02
Eurohome UK Mortgages PLC				
3,946 % éch. 15/06/2044		96	92	0,02
EuroMASTR PLC				
3,996 % éch. 15/06/2040		553	513	0,13
Finsbury Square PLC				
4,419 % éch. 16/12/2069		534	534	0,14
Gosforth Funding PLC				
3,997 % éch. 25/08/2060		370	370	0,09
Great Hall Mortgages PLC				
3,675 % éch. 18/03/2039		495	488	0,13
3,695 % éch. 18/06/2038		9	9	0,00
Harbour Energy PLC				
3,944 % éch. 28/01/2054		300	286	0,07
Hops Hill PLC				
4,382 % éch. 27/05/2054		665	658	0,17
Lanark Master Issuer PLC				
3,848 % éch. 22/12/2069		240	240	0,06
London Wall Mortgage Capital PLC				
3,990 % éch. 15/05/2051		390	379	0,10
Ludgate Funding PLC				
3,930 % éch. 01/01/2061		1 732	1 638	0,42
Mansard Mortgages PLC				
4,172 % éch. 15/12/2049		89	86	0,02
Mortimer BTL PLC				
4,137 % éch. 23/06/2053		1 781	1 736	0,45
4,492 % éch. 23/03/2054		884	864	0,22
Newgate Funding PLC				
2,646 % éch. 15/12/2050	€	845	699	0,18
Polaris PLC				
4,222 % éch. 23/12/2058	£	1 203	1 174	0,30
4,732 % éch. 23/05/2059		1 221	1 207	0,31
Residential Mortgage Securities PLC				
4,681 % éch. 20/06/2070	£	1 184	£ 1 179	0,30
RMAC PLC				
4,206 % éch. 12/06/2046		1 462	1 455	0,37
4,476 % éch. 12/06/2046		687	685	0,18
Stratton Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2060		1 386	1 374	0,35
4,287 % éch. 12/03/2052		68	68	0,02
4,292 % éch. 25/09/2051		75	74	0,02
Towd Point Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2045		269	266	0,07
4,071 % éch. 20/10/2051		1 552	1 543	0,40
Twin Bridges PLC				
4,237 % éch. 12/03/2055		1 463	1 431	0,37
			23 616	6,07
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Bon du Trésor britannique				
0,125 % éch. 31/01/2023		67 600	67 466	17,33
1,250 % éch. 31/07/2051		3 400	1 838	0,47
1,500 % éch. 31/07/2053		12 600	7 231	1,86
3,750 % éch. 22/07/2052		1 800	1 738	0,45
4,250 % éch. 07/03/2036		10 500	10 861	2,79
			89 134	22,90
Total Royaume-Uni			233 088	59,89
ÉTATS-UNIS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AES Corp.				
2,450 % éch. 15/01/2031	$	900	597	0,15
Amgen, Inc.				
4,000 % éch. 13/09/2029	£	740	699	0,18
Apple, Inc.				
3,050 % éch. 31/07/2029		500	468	0,12
3,600 % éch. 31/07/2042		600	527	0,14
4,450 % éch. 06/05/2044	$	300	236	0,06
AT&T, Inc.				
4,250 % éch. 01/06/2043	£	1 800	1 470	0,38
4,375 % éch. 14/09/2029		1 000	943	0,24
4,875 % éch. 01/06/2044		500	444	0,11
Bank of America Corp.				
3,584 % éch. 27/04/2031		2 800	2 472	0,64
Berkshire Hathaway Finance Corp.				
2,375 % éch. 19/06/2039		1 600	1 134	0,29
Blue Owl Finance LLC				
3,125 % éch. 10/06/2031	$	550	341	0,09
Booking Holdings, Inc.				
4,250 % éch. 15/05/2029	€	400	357	0,09
Citigroup, Inc.				
1,750 % éch. 23/10/2026	£	1 000	881	0,23
2,750 % éch. 24/01/2024		650	636	0,16
4,500 % éch. 03/03/2031		1 000	905	0,23
5,150 % éch. 21/05/2026		1 060	1 063	0,27
Comcast Corp.				
1,500 % éch. 20/02/2029		400	329	0,08
1,875 % éch. 20/02/2036		1 200	851	0,22
Digital Stout Holding LLC				
3,300 % éch. 19/07/2029		816	684	0,18
3,750 % éch. 17/10/2030		1 350	1 132	0,29
Eli Lilly & Co.				
1,625 % éch. 14/09/2043		800	485	0,12
Entergy Corp.				
2,800 % éch. 15/06/2030	$	300	211	0,05
Fidelity National Information Services, Inc.				
3,360 % éch. 21/05/2031	£	400	345	0,09
Fiserv, Inc.				
3,000 % éch. 01/07/2031		791	660	0,17
Ford Motor Co.				
3,250 % éch. 12/02/2032	$	150	94	0,02
Ford Motor Credit Co. LLC				
2,748 % éch. 14/06/2024	£	900	853	0,22
Goldman Sachs Group, Inc.				
1,875 % éch. 16/12/2030		3 200	2 455	0,63
3,625 % éch. 29/10/2029		2 250	2 010	0,52
JPMorgan Chase & Co.				
1,895 % éch. 28/04/2033		1 200	903	0,23

Tableau des investissements Fonds UK Corporate Bond Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
3,882 % éch. 24/07/2038	$ 200	£ 139	0,04
4,203 % éch. 23/07/2029	400	310	0,08
Liberty Mutual Group, Inc.			
4,625 % éch. 02/12/2030	€ 500	424	0,11
MassMutual Global Funding			
1,375 % éch. 15/12/2026	£ 700	614	0,16
McDonald's Corp.			
2,950 % éch. 15/03/2034	500	413	0,11
Metropolitan Life Global Funding			
0,625 % éch. 08/12/2027	400	327	0,08
1,625 % éch. 21/09/2029	400	328	0,08
3,500 % éch. 30/09/2026	740	705	0,18
Morgan Stanley			
5,789 % éch. 18/11/2033	900	903	0,23
MPT Operating Partnership LP			
2,500 % éch. 24/03/2026	1 400	1 115	0,29
2,550 % éch. 05/12/2023	200	190	0,05
3,692 % éch. 05/06/2028	400	294	0,08
Nestle Holdings, Inc.			
2,500 % éch. 04/04/2032	1 500	1 265	0,33
Netflix, Inc.			
3,875 % éch. 15/11/2029	€ 600	499	0,13
New York Life Global Funding			
1,250 % éch. 17/12/2026	£ 500	436	0,11
4,350 % éch. 16/09/2025	1 600	1 585	0,41
Oracle Corp.			
6,150 % éch. 09/11/2029 (g)	$ 1 100	951	0,24
6,250 % éch. 09/11/2032 (g)	400	349	0,09
Pfizer, Inc.			
2,735 % éch. 15/06/2043	£ 1 000	731	0,19
Realty Income Corp.			
1,750 % éch. 13/07/2033	1 100	760	0,20
T-Mobile USA, Inc.			
3,875 % éch. 15/04/2030	$ 400	£ 302	0,08
5,200 % éch. 15/01/2033	100	83	0,02
Time Warner Cable LLC			
5,250 % éch. 15/07/2042	£ 1 100	887	0,23
Verizon Communications, Inc.			
1,875 % éch. 19/09/2030	500	398	0,10
1,875 % éch. 03/11/2038	700	445	0,11
2,500 % éch. 08/04/2031	1 400	1 152	0,30
3,125 % éch. 02/11/2035	200	160	0,04
3,375 % éch. 27/10/2036	1 200	977	0,25
4,750 % éch. 17/02/2034	550	526	0,14
Wells Fargo & Co.			
2,125 % éch. 24/09/2031	1 800	1 379	0,35
2,500 % éch. 02/05/2029	1 750	1 456	0,37
3,500 % éch. 12/09/2029	700	618	0,16
Welltower, Inc.			
4,800 % éch. 20/11/2028	500	464	0,12
		45 370	11,66
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust			
4,889 % éch. 25/04/2035	$ 95	74	0,02
Sequoia Mortgage Trust			
3,051 % éch. 20/07/2037 ^	7	4	0,00
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust			
3,780 % éch. 25/02/2034	1	1	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
3,248 % éch. 25/11/2042	13	10	0,00
		89	0,02
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Fannie Mae			
2,560 % éch. 01/08/2036	$ 4	£ 3	0,00
2,889 % éch. 01/07/2044	4	3	0,00
		6	0,00
Total États-Unis		45 465	11,68
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BONS DU TRÉSOR BRITANNIQUE			
3,360 % éch. 13/03/2023 (b)(c)	£ 1 500	1 491	0,38
Total des Instruments à court terme		1 491	0,38
Total des Valeurs mobilières		**£ 372 745**	**95,78**

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
FONDS D'INVESTISSEMENT			
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (e)	2 500	214	0,06
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (e)	51 000	5 156	1,32
Total des Fonds d'investissement		**£ 5 370**	**1,38**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
FICC	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 213	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 29/06/2023	£ (181)	£ 177	£ 177	0,05
Total des Contrats de mise en pension						**£ (181)**	**£ 177**	**£ 177**	**0,05**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Court	03/2023	27	£ 91	0,03
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	61	464	0,12
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Court	03/2023	5	82	0,02
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Court	03/2023	96	4	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Long	03/2023	119	(26)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	14	(4)	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	2	1	0,00
				£ 612	0,16
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**£ 612**	**0,16**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Rolls-Royce PLC	1,000 %	20/06/2024	€ 1 700	£ (21)	(0,01)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000 %	20/12/2027	$ 28 700	£ 264	0,07
Indice iTraxx Europe Main 37 à 5 ans	1,000	20/06/2027	€ 4 350	11	0,00
Indice iTraxx Europe Main 38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	13 300	124	0,03
				£ 399	0,10

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	0,500 %	21/09/2024	£ 59 600	£ (170)	(0,04)
À recevoir[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2033	1 100	30	0,01
À payer[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250	15/03/2028	18 000	31	0,01
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,728	16/12/2025	44 800	(365)	(0,09)
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	4,000	08/11/2027	20 800	85	0,02
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/12/2026	$ 3 100	(279)	(0,07)
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	17/06/2030	9 200	1 448	0,37
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	18/12/2029	9 300	1 018	0,26
À payer	LIBOR USD à 3 mois	2,000	12/02/2045	2 100	(451)	(0,12)
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2025	€ 10 300	196	0,05
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028	400	15	0,00
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	3 500	(48)	(0,01)
					£ 1 510	0,39
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**£ 1 888**	**0,48**

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente - Indice iTraxx Europe 37 à 5 ans hors cote	Vente	3,000 %	15/03/2023	1 900	£ (3)	£ 0	0,00

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547 %	07/03/2023	1 600	£ (29)	£ (3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	1 600	(29)	(84)	(0,03)
							£ (58)	£ (87)	(0,03)

(1) Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	02/2023	€ 133	£ 117	£ 0	£ (1)	£ (1)	0,00
	02/2023	$ 15 253	12 926	261	0	261	0,07
JPM	01/2023	8	CNY 54	0	0	0	0,00
	03/2023	14	97	0	0	0	0,00
MBC	02/2023	€ 2 345	£ 2 048	0	(36)	(36)	(0,01)
	02/2023	£ 317	€ 361	4	0	4	0,00
	02/2023	425	$ 508	0	(3)	(3)	0,00
	02/2023	¥ 13 900	£ 85	0	(3)	(3)	0,00
	02/2023	$ 3 071	2 579	32	(3)	29	0,01
MYI	02/2023	€ 353	306	0	(8)	(8)	0,00
SSB	02/2023	19 078	16 744	0	(213)	(213)	(0,06)

Tableau des investissements Fonds UK Corporate Bond Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
UAG	02/2023	£ 83	$ 100	£ 0	£ 0	£ 0	0,00
				£ 297	£ (267)	£ 30	0,01
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						**£ (57)**	**(0,02)**
Total des Investissements						**£ 380 735**	**97,83**
Autres actifs et passifs à court terme						**£ 8 438**	**2,17**
Actif net						**£ 389 173**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à rémunération en nature.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titre convertible conditionnel.

(g) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,04 %) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Oracle Corp.	6,150 %	09/11/2029	07/11/2022	£ 959	£ 951	0,24
Oracle Corp.	6,250	09/11/2032	07/11/2022	348	349	0,09
				£ 1 307	£ 1 300	0,33

Un titre d'une juste valeur globale de 0 £ (31 décembre 2021 : 514 £) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 7 199 £ (31 décembre 2021 : 9 505 £) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	£ 0	£ 372 745	£ 0	£ 372 745
Fonds d'investissement	0	5 370	0	5 370
Contrats de mise en pension	0	177	0	177
Instruments financiers dérivés[3]	637	1 806	0	2 443
Totaux	**£ 637**	**£ 380 098**	**£ 0**	**£ 380 735**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	£ 0	£ 571 865	£ 0	£ 571 865
Fonds d'investissement	208	0	0	208
Contrats de mise en pension	0	526	0	526
Instruments financiers dérivés[3]	160	(1 074)	0	(914)
Totaux	**£ 368**	**£ 571 317**	**£ 0**	**£ 571 685**

[1] Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

[2] Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

[3] Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	£ 260	£ (330)	£ (70)	£ (80)	£ 0	£ (80)
BRC	S/O	S/O	S/O	(14)	0	(14)
CBK	S/O	S/O	S/O	391	0	391
DUB	S/O	S/O	S/O	9	0	9
GLM	(87)	0	(87)	(52)	0	(52)
HUS	S/O	S/O	S/O	21	0	21
JPM	S/O	S/O	S/O	177	(189)	(12)
MBC	(9)	0	(9)	S/O	S/O	S/O
MYC	S/O	S/O	S/O	(3)	0	(3)
MYI	(8)	0	(8)	(7)	0	(7)
RBC	S/O	S/O	S/O	(14)	0	(14)
SCX	S/O	S/O	S/O	(27)	0	(27)
SSB	(213)	0	(213)	S/O	S/O	S/O
UAG	S/O	S/O	S/O	345	0	345

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	94,43	93,80
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	1,35	2,74
Autres valeurs mobilières	S/O	0,02
Fonds d'investissement	1,38	0,04
Contrats de mise en pension	0,05	0,09
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,16	0,02
Instruments financiers dérivés compensés	0,48	(0,30)
Instruments financiers dérivés hors cote	(0,02)	0,13
Contrats de prise en pension	S/O	(0,09)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Australie	S/O	0,09
Autriche	0,05	0,18
Belgique	0,07	0,75
Brésil	S/O	0,27
Canada	0,20	0,37
Îles Caïmans	0,12	0,31
Danemark	0,82	0,43
Finlande	S/O	0,41
France	3,51	4,09
Allemagne	2,21	1,95
Guernesey, Îles Anglo-normandes	S/O	0,27
Inde	S/O	0,04
Irlande	1,24	1,73
Île de Man	S/O	0,13
Italie	0,57	2,26
Japon	0,31	0,49
Jersey, Îles Anglo-normandes	1,71	2,52
Luxembourg	1,18	2,59
Île Maurice	S/O	0,39
Pays-Bas	5,67	5,25
Norvège	0,42	0,13
Singapour	0,20	0,41
Slovénie	S/O	0,13
Corée du Sud	S/O	0,06
Espagne	1,11	1,56
Supranationales	3,11	2,95
Suède	0,44	0,42
Suisse	0,89	2,09
Royaume-Uni	59,89	52,85
États-Unis	11,68	11,42
Instruments à court terme	0,38	0,02
Fonds d'investissement	1,38	0,04
Contrats de mise en pension	0,05	0,09
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,16	0,02
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,01)	(0,01)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,10	0,01
Swaps de taux d'intérêt	0,39	(0,30)

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,03)	S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	S/O	0,03
Contrats de change à terme	0,01	0,10
Autres actifs et passifs à court terme	2,17	3,46
Actif net	100,00	100,00

Tableau des investissements Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund

31 décembre 2022

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
BELGIQUE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Sofina S.A.				
1,000 % éch. 23/09/2028	€	900	£ 624	0,19
DANEMARK				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Orsted A/S				
2,500 % éch. 16/05/2033	£	600	475	0,15
5,125 % éch. 13/09/2034		900	889	0,27
5,375 % éch. 13/09/2042		2 100	2 110	0,65
TDC Net A/S				
5,056 % éch. 31/05/2028	€	600	524	0,16
Total Danemark			3 998	1,23
FRANCE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Accor S.A.				
2,375 % éch. 29/11/2028		200	152	0,05
AXA S.A.				
5,453 % éch. 04/03/2026 (d)	£	600	586	0,18
5,625 % éch. 16/01/2054		400	376	0,11
BNP Paribas S.A.				
2,000 % éch. 13/09/2036		600	398	0,12
2,875 % éch. 24/02/2029		200	170	0,05
4,625 % éch. 12/01/2027 (d)(e)	$	400	274	0,08
4,625 % éch. 25/02/2031 (d)(e)		800	516	0,16
7,750 % éch. 16/08/2029 (d)(e)		500	412	0,13
BPCE S.A.				
2,125 % éch. 13/10/2046 (e)	€	400	249	0,08
Électricité de France S.A.				
5,125 % éch. 22/09/2050	£	4 000	3 514	1,08
5,500 % éch. 27/03/2037		3 500	3 321	1,02
5,500 % éch. 17/10/2041		4 100	3 834	1,18
Engie S.A.				
5,000 % éch. 01/10/2060		200	185	0,06
Orange S.A.				
5,625 % éch. 23/01/2034		1 575	1 630	0,50
Peugeot Invest				
1,875 % éch. 30/10/2026	€	400	292	0,09
			15 909	4,89
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
SNCF Réseau				
5,000 % éch. 11/03/2052	£	400	396	0,12
5,250 % éch. 31/01/2035		300	308	0,10
			704	0,22
Total France			16 613	5,11
ALLEMAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Commerzbank AG				
8,625 % éch. 28/02/2033		800	804	0,25
Deutsche Bank AG				
1,375 % éch. 17/02/2032	€	400	259	0,08
1,875 % éch. 22/12/2028	£	3 600	2 867	0,88
Deutsche Telekom AG				
3,125 % éch. 06/02/2034		400	337	0,10
Hamburg Commercial Bank AG				
6,250 % éch. 18/11/2024	€	900	809	0,25
IHO Verwaltungs GmbH (3,750 % en numéraire ou 4,500 % de rémunération en nature)				
3,750 % éch. 15/09/2026 (a)		200	155	0,05
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau				
0,875 % éch. 15/09/2026	£	3 400	3 005	0,92
5,750 % éch. 07/06/2032		300	337	0,10
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen				
1,000 % éch. 26/05/2042	€	300	187	0,06
Schaeffler AG				
2,750 % éch. 12/10/2025		300	254	0,08
Sixt SE				
1,750 % éch. 09/12/2024		100	86	0,03
Total Allemagne			9 100	2,80
INDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
ReNew Power Pvt Ltd.				
5,875 % éch. 05/03/2027	$	200	£ 160	0,05
IRLANDE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Toro European CLO DAC				
2,239 % éch. 12/01/2032	€	2 600	2 222	0,68
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Bank of Ireland Group PLC				
6,750 % éch. 01/03/2033		100	88	0,03
CCEP Finance Ireland DAC				
1,500 % éch. 06/05/2041		900	535	0,16
ESB Finance DAC				
1,875 % éch. 21/07/2035	£	300	211	0,07
GE Capital UK Funding Unlimited Co.				
5,875 % éch. 18/01/2033		2 500	2 544	0,78
Permanent TSB Group Holdings PLC				
2,125 % éch. 26/09/2024	€	800	681	0,21
Perrigo Finance Unlimited Co.				
4,400 % éch. 15/06/2030	$	200	142	0,04
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.				
3,000 % éch. 19/04/2051		900	575	0,18
5,125 % éch. 23/11/2052	£	600	546	0,17
			5 322	1,64
Total Irlande			7 544	2,32
ITALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Aeroporti di Roma SpA				
1,750 % éch. 30/07/2031	€	100	66	0,02
5,441 % éch. 20/02/2023	£	300	300	0,09
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA				
2,625 % éch. 28/04/2025	€	1 000	805	0,25
Enel SpA				
5,750 % éch. 22/06/2037	£	700	689	0,21
Nexi SpA				
1,625 % éch. 30/04/2026	€	120	97	0,03
2,125 % éch. 30/04/2029		400	289	0,09
			2 246	0,69
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement italien				
5,250 % éch. 07/12/2034	£	300	287	0,09
Total Italie			2 533	0,78
JAPON				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
East Japan Railway Co.				
5,250 % éch. 22/04/2033		300	302	0,09
JERSEY, ÎLES ANGLO-NORMANDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AA Bond Co. Ltd.				
3,250 % éch. 31/07/2050		1 300	973	0,30
4,875 % éch. 31/07/2043		1 600	1 517	0,46
5,500 % éch. 31/07/2050		180	156	0,05
Gatwick Funding Ltd.				
3,125 % éch. 28/09/2041		1 000	688	0,21
Heathrow Funding Ltd.				
2,750 % éch. 09/08/2051		1 700	1 006	0,31
4,625 % éch. 31/10/2046		2 277	1 876	0,58
5,875 % éch. 13/05/2043		300	293	0,09
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP				
5,844 % éch. 05/11/2031 (d)		2 321	2 375	0,73
Total Jersey, Îles Anglo-normandes			8 884	2,73
LUXEMBOURG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Aroundtown S.A.				
3,000 % éch. 16/10/2029		300	189	0,06
3,625 % éch. 10/04/2031		400	244	0,08
Becton Dickinson Euro Finance SARL				
1,336 % éch. 13/08/2041	€	1 200	£ 663	0,20
Bevco Lux SARL				
1,000 % éch. 16/01/2030		600	401	0,12
CK Hutchison Group Telecom Finance S.A.				
2,625 % éch. 17/10/2034	£	1 350	915	0,28
CPI Property Group S.A.				
2,750 % éch. 22/01/2028		1 200	804	0,25
Prologis International Funding S.A.				
3,000 % éch. 22/02/2042		1 000	697	0,22
Total Luxembourg			3 913	1,21
MEXIQUE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
America Movil S.A.B. de C.V.				
4,375 % éch. 07/08/2041		388	329	0,10
4,948 % éch. 22/07/2033		100	95	0,03
Total Mexique			424	0,13
PAYS-BAS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
ABN AMRO Bank NV				
4,375 % éch. 22/09/2025 (d)(e)	€	500	410	0,13
Cooperatieve Rabobank UA				
3,100 % éch. 29/06/2028 (d)(e)		200	138	0,04
4,625 % éch. 23/05/2029	£	200	183	0,06
4,875 % éch. 29/06/2029 (d)(e)	€	800	611	0,19
5,250 % éch. 14/09/2027	£	850	821	0,25
CTP NV				
1,250 % éch. 21/06/2029	€	400	237	0,07
Digital Dutch Finco BV				
1,000 % éch. 15/01/2032		200	125	0,04
E.ON International Finance BV				
4,750 % éch. 31/01/2034	£	3 100	2 860	0,88
5,875 % éch. 30/10/2037		2 300	2 312	0,71
6,125 % éch. 06/07/2039		1 650	1 698	0,52
Enel Finance International NV				
5,000 % éch. 15/06/2032	$	400	300	0,09
5,750 % éch. 14/09/2040	£	2 763	2 695	0,83
7,750 % éch. 14/10/2052	$	250	223	0,07
Holcim Sterling Finance Netherlands BV				
2,250 % éch. 04/04/2034	£	800	549	0,17
3,000 % éch. 12/05/2032		300	237	0,07
IMCD NV				
2,125 % éch. 31/03/2027	€	300	236	0,07
JAB Holdings BV				
2,250 % éch. 19/12/2039		900	545	0,17
JDE Peet's NV				
1,125 % éch. 16/06/2033		400	258	0,08
NN Group NV				
5,250 % éch. 01/03/2043		200	165	0,05
Siemens Financieringsmaatschappij NV				
3,750 % éch. 10/09/2042	£	400	353	0,11
Stichting AK Rabobank Certificaten				
6,500 % (d)	€	1 481	1 263	0,39
Thermo Fisher Scientific Finance BV				
2,000 % éch. 18/10/2051		500	281	0,09
Volkswagen Financial Services NV				
0,875 % éch. 20/02/2025	£	100	90	0,03
2,125 % éch. 18/01/2028		100	83	0,02
Volkswagen International Finance NV				
3,500 % éch. 17/06/2025 (d)	€	300	247	0,08
3,875 % éch. 17/06/2029 (d)		500	369	0,11
			17 289	5,32
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Nederlandse Waterschapsbank NV				
5,375 % éch. 07/06/2032	£	400	432	0,13
Total Pays-Bas			17 721	5,45
NORVÈGE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Aker BP ASA				
3,750 % éch. 15/01/2030	$	350	257	0,08

Tableau des investissements Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Equinor ASA				
4,250 % éch. 10/04/2041	£	700	£ 623	0,19
Total Norvège			880	0,27
SINGAPOUR				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Temasek Financial Ltd.				
5,125 % éch. 26/07/2040		1 050	1 069	0,33
ESPAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
5,875 % éch. 24/09/2023 (d)(e)	€	200	171	0,05
CaixaBank S.A.				
3,625 % éch. 14/09/2028 (d)(e)		600	376	0,12
6,750 % éch. 13/06/2024 (d)(e)		200	174	0,05
Total Espagne			721	0,22
SUPRANATIONALES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banque européenne d'investissement				
3,875 % éch. 08/06/2037	£	1 200	1 141	0,35
5,625 % éch. 07/06/2032		200	223	0,07
6,000 % éch. 07/12/2028		1 700	1 856	0,57
Banque internationale pour la reconstruction et le développement				
0,100 % éch. 17/09/2035	€	1 000	604	0,19
Total Supranationales			3 824	1,18
SUÈDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
EQT AB				
2,875 % éch. 06/04/2032		300	216	0,06
Investor AB				
5,500 % éch. 05/05/2037	£	300	315	0,10
Total Suède			531	0,16
SUISSE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Credit Suisse Group AG				
3,091 % éch. 14/05/2032	$	500	288	0,09
4,194 % éch. 01/04/2031		250	162	0,05
6,250 % éch. 18/12/2024 (d)(e)		400	262	0,08
7,500 % éch. 17/07/2023 (d)(e)		200	133	0,04
7,500 % éch. 11/12/2023 (d)(e)		2 400	1 748	0,54
UBS AG				
5,125 % éch. 15/05/2024 (e)		300	247	0,08
UBS Group AG				
3,126 % éch. 13/08/2030		200	141	0,04
4,375 % éch. 10/02/2031 (d)(e)		800	507	0,16
4,875 % éch. 12/02/2027 (d)(e)		300	212	0,06
5,125 % éch. 29/07/2026 (d)(e)		300	234	0,07
Total Suisse			3 934	1,21
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
3i Group PLC				
3,750 % éch. 05/06/2040	£	1 400	1 025	0,31
Accent Capital PLC				
2,625 % éch. 18/07/2049		400	252	0,08
Annington Funding PLC				
2,308 % éch. 06/10/2032		1 300	937	0,29
2,924 % éch. 06/10/2051		2 500	1 434	0,44
3,685 % éch. 12/07/2034		919	722	0,22
Arqiva Financing PLC				
4,882 % éch. 31/12/2032		443	421	0,13
5,340 % éch. 30/12/2037		100	95	0,03
Aviva PLC				
4,000 % éch. 03/06/2055		1 000	769	0,24
Barclays PLC				
3,250 % éch. 17/01/2033		1 530	1 197	0,37
7,250 % éch. 15/03/2023 (d)(e)		600	595	0,18
7,750 % éch. 15/09/2023 (d)(e)	$	200	163	0,05
8,000 % éch. 15/06/2024 (d)(e)		600	486	0,15
8,407 % éch. 14/11/2032	£	800	827	0,25
8,875 % éch. 15/09/2027 (d)(e)		500	494	0,15
Berkeley Group PLC				
2,500 % éch. 11/08/2031	£	800	£ 537	0,16
BG Energy Capital PLC				
5,000 % éch. 04/11/2036		300	291	0,09
Blend Funding PLC				
3,459 % éch. 21/09/2049		300	224	0,07
BPHA Finance PLC				
4,816 % éch. 11/04/2044		495	462	0,14
British Land Co. PLC				
2,375 % éch. 14/09/2029		600	474	0,15
5,264 % éch. 24/09/2035		400	377	0,12
British Telecommunications PLC				
3,125 % éch. 21/11/2031		400	334	0,10
3,625 % éch. 21/11/2047		300	211	0,06
Broadgate Financing PLC				
4,999 % éch. 05/10/2033		600	575	0,18
5,098 % éch. 05/04/2035		89	82	0,02
Cadent Finance PLC				
2,250 % éch. 10/10/2035		500	344	0,11
2,625 % éch. 22/09/2038		2 700	1 835	0,56
2,750 % éch. 22/09/2046		1 300	802	0,25
Catalyst Housing Ltd.				
3,125 % éch. 31/10/2047		900	609	0,19
Chancellor Masters & Scholars of The University of Cambridge				
2,350 % éch. 27/06/2078		200	119	0,04
3,750 % éch. 17/10/2052		800	707	0,22
Chanel Ceres PLC				
1,000 % éch. 31/07/2031	€	1 000	685	0,21
Church Commissioners for England				
3,625 % éch. 14/07/2052	£	1 400	1 132	0,35
Citizen Treasury PLC				
3,250 % éch. 20/10/2048		700	510	0,16
Clarion Funding PLC				
1,250 % éch. 13/11/2032		100	69	0,02
1,875 % éch. 22/01/2035		2 000	1 361	0,42
1,875 % éch. 07/09/2051		2 500	1 215	0,37
3,125 % éch. 19/04/2048		1 000	673	0,21
Compass Group PLC				
4,375 % éch. 08/09/2032		700	672	0,21
Derwent London PLC				
1,875 % éch. 17/11/2031		1 750	1 237	0,38
Diageo Finance PLC				
2,750 % éch. 08/06/2038		600	461	0,14
Direct Line Insurance Group PLC				
4,000 % éch. 05/06/2032		300	236	0,07
Drax Finco PLC				
6,625 % éch. 01/11/2025	$	200	159	0,05
Eastern Power Networks PLC				
2,125 % éch. 25/11/2033	£	721	538	0,17
EMH Treasury PLC				
4,500 % éch. 29/01/2044		800	714	0,22
Eversholt Funding PLC				
3,529 % éch. 07/08/2042		800	577	0,18
Futures Treasury PLC				
3,375 % éch. 08/02/2044		1 000	757	0,23
GlaxoSmithKline Capital PLC				
1,625 % éch. 12/05/2035		2 900	2 038	0,63
5,250 % éch. 19/12/2033		105	110	0,03
6,375 % éch. 09/03/2039		500	575	0,18
Grainger PLC				
3,000 % éch. 03/07/2030		2 100	1 578	0,49
3,375 % éch. 24/04/2028		100	83	0,03
Great Places Housing Group Ltd.				
4,750 % éch. 22/10/2042		1 000	931	0,29
Greene King Finance PLC				
3,593 % éch. 15/03/2035		737	615	0,19
4,064 % éch. 15/03/2035		281	238	0,07
5,106 % éch. 15/03/2034		2 231	1 966	0,60
5,318 % éch. 15/09/2031		2 202	2 046	0,63
GSK Consumer Healthcare Capital UK PLC				
2,875 % éch. 29/10/2028		152	136	0,04
3,375 % éch. 29/03/2038		1 320	1 049	0,32
Guinness Partnership Ltd.				
4,000 % éch. 24/10/2044		1 000	822	0,25
Hexagon Housing Association Ltd.				
3,625 % éch. 22/04/2048		1 300	943	0,29
High Speed Rail Finance PLC				
4,375 % éch. 01/11/2038	£	800	£ 719	0,22
Home Group Ltd.				
3,125 % éch. 27/03/2043		1 300	915	0,28
HSBC Holdings PLC				
4,600 % éch. 17/12/2030 (d)(e)	$	200	130	0,04
4,950 % éch. 31/03/2030		200	159	0,05
5,875 % éch. 28/09/2026 (d)(e)	£	200	179	0,05
6,000 % éch. 29/03/2040		500	458	0,14
Jigsaw Funding PLC				
3,375 % éch. 05/05/2052		800	598	0,18
John Lewis PLC				
4,250 % éch. 18/12/2034		2 222	1 352	0,42
Juturna European Loan Conduit PLC				
5,064 % éch. 10/08/2033		997	986	0,30
Karbon Homes Ltd.				
3,375 % éch. 15/11/2047		300	226	0,07
Land Securities Capital Markets PLC				
2,625 % éch. 22/09/2039		1 373	1 011	0,31
2,750 % éch. 22/09/2059		301	189	0,06
LCR Finance PLC				
4,500 % éch. 07/12/2038		75	75	0,02
Legal & General Group PLC				
4,500 % éch. 01/11/2050		400	347	0,11
5,500 % éch. 27/06/2064		100	90	0,03
5,625 % éch. 24/03/2031 (d)(e)		900	777	0,24
Lendlease Europe Finance PLC				
3,500 % éch. 02/12/2033		1 300	836	0,26
Liberty Living Finance PLC				
3,375 % éch. 28/11/2029		600	492	0,15
Lloyds Banking Group PLC				
5,125 % éch. 27/12/2024 (d)(e)		1 000	923	0,28
7,875 % éch. 27/06/2029 (d)(e)		1 000	958	0,29
London & Quadrant Housing Trust				
2,000 % éch. 31/03/2032		2 000	1 514	0,47
2,000 % éch. 20/10/2038		900	560	0,17
3,125 % éch. 28/02/2053		1 000	644	0,20
3,750 % éch. 27/10/2049		300	221	0,07
Longstone Finance PLC				
4,896 % éch. 19/04/2036		100	93	0,03
M&G PLC				
5,560 % éch. 20/07/2055		2 550	2 196	0,68
Manchester Airport Group Funding PLC				
2,875 % éch. 30/09/2044		2 050	1 315	0,40
4,750 % éch. 31/03/2034		200	184	0,06
Marks & Spencer PLC				
3,750 % éch. 19/05/2026		300	262	0,08
6,000 % éch. 12/06/2025		204	197	0,06
Meadowhall Finance PLC				
4,988 % éch. 12/07/2037		63	54	0,02
Metropolitan Housing Trust Ltd.				
1,875 % éch. 28/07/2036		2 300	1 513	0,47
Mitchells & Butlers Finance PLC				
5,219 % éch. 15/12/2030	$	713	549	0,17
5,517 % éch. 15/09/2034	£	993	794	0,24
5,965 % éch. 15/12/2025		73	72	0,02
6,013 % éch. 15/12/2030		540	505	0,15
Morhomes PLC				
3,400 % éch. 19/02/2040		4 200	3 266	1,00
Motability Operations Group PLC				
1,500 % éch. 20/01/2041		800	479	0,15
2,125 % éch. 18/01/2042		2 600	1 718	0,53
2,375 % éch. 03/07/2039		1 400	1 009	0,31
National Grid Electricity Distribution East Midlands PLC				
1,750 % éch. 09/09/2031		200	150	0,05
6,250 % éch. 10/12/2040		500	528	0,16
National Grid Electricity Distribution South Wales PLC				
1,625 % éch. 07/10/2035		1 100	708	0,22
National Grid Electricity Distribution South West PLC				
5,750 % éch. 23/03/2040		700	701	0,22
National Grid Electricity Transmission PLC				
2,000 % éch. 16/09/2038		1 200	754	0,23
2,000 % éch. 17/04/2040		2 008	1 221	0,38
2,750 % éch. 06/02/2035		600	450	0,14
Nationwide Building Society				
5,875 % éch. 20/12/2024 (d)(e)		700	663	0,20

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
NatWest Group PLC				
2,057 % éch. 09/11/2028	£	1 000	£ 835	0,26
3,619 % éch. 29/03/2029		1 200	1 050	0,32
4,600 % éch. 28/06/2031 (d)(e)	$	800	478	0,15
5,076 % éch. 27/01/2030		950	746	0,23
Network Rail Infrastructure Finance PLC				
4,750 % éch. 29/11/2035	£	400	409	0,13
NIE Finance PLC				
5,875 % éch. 01/12/2032		400	413	0,13
Northern Electric Finance PLC				
2,750 % éch. 24/05/2049		950	634	0,19
Northern Gas Networks Finance PLC				
4,875 % éch. 15/11/2035		200	185	0,06
5,625 % éch. 23/03/2040		500	484	0,15
Northern Powergrid Northeast PLC				
1,875 % éch. 16/06/2062		100	51	0,02
3,250 % éch. 01/04/2052		500	362	0,11
Northern Powergrid Yorkshire PLC				
2,250 % éch. 09/10/2059		1 000	567	0,17
5,125 % éch. 04/05/2035		710	691	0,21
Northumbrian Water Finance PLC				
5,625 % éch. 29/04/2033		400	402	0,12
6,375 % éch. 28/10/2034		1 020	1 086	0,33
Notting Hill Genesis				
2,000 % éch. 03/06/2036		2 234	1 490	0,46
3,250 % éch. 12/10/2048		1 141	779	0,24
5,250 % éch. 07/07/2042		199	191	0,06
Orbit Capital PLC				
3,375 % éch. 14/06/2048		700	496	0,15
Pacific Quay Finance PLC				
5,565 % éch. 25/07/2034		786	801	0,25
Paragon Treasury PLC				
2,000 % éch. 07/05/2036		1 300	887	0,27
Peabody Capital PLC				
3,250 % éch. 14/09/2048		1 800	1 240	0,38
Places for People Homes Ltd.				
5,875 % éch. 23/05/2031		700	708	0,22
Places for People Treasury PLC				
2,500 % éch. 26/01/2036		500	349	0,11
Platform HG Financing PLC				
1,926 % éch. 15/09/2041		1 200	742	0,23
Prudential PLC				
6,125 % éch. 19/12/2031		620	615	0,19
RHP Finance PLC				
3,250 % éch. 05/02/2048		700	511	0,16
Riverside Finance PLC				
3,875 % éch. 05/12/2044		400	329	0,10
Rolls-Royce PLC				
4,625 % éch. 16/02/2026	€	700	604	0,19
Sage Group PLC				
1,625 % éch. 25/02/2031	£	600	449	0,14
2,875 % éch. 08/02/2034		700	540	0,17
Sanctuary Capital PLC				
5,000 % éch. 26/04/2047		500	468	0,14
Santander UK Group Holdings PLC				
3,625 % éch. 14/01/2026		100	93	0,03
6,750 % éch. 24/06/2024 (d)(e)		400	385	0,12
7,098 % éch. 16/11/2027		500	507	0,16
Santander UK PLC				
6,500 % éch. 21/10/2030		100	103	0,03
Scottish Hydro Electric Transmission PLC				
2,125 % éch. 24/03/2036		2 000	1 373	0,42
2,250 % éch. 27/09/2035		200	141	0,04
Severn Trent Utilities Finance PLC				
2,000 % éch. 02/06/2040		1 800	1 131	0,35
2,625 % éch. 22/02/2033		556	444	0,14
4,625 % éch. 30/11/2034		300	282	0,09
4,875 % éch. 24/01/2042		1 200	1 131	0,35
Society of Lloyd's				
4,875 % éch. 07/02/2047		1 800	1 678	0,52
South Eastern Power Networks PLC				
1,750 % éch. 30/09/2034		5 000	3 491	1,07
Southern Electric Power Distribution PLC				
4,625 % éch. 20/02/2037		1 500	1 346	0,41
Southern Gas Networks PLC				
3,100 % éch. 15/09/2036		2 100	1 579	0,49
Southern Housing Group Ltd.				
2,375 % éch. 08/10/2036	£	1 500	£ 1 057	0,32
3,500 % éch. 19/10/2047		1 400	1 008	0,31
Sovereign Housing Capital PLC				
2,375 % éch. 04/11/2048		200	121	0,04
Standard Chartered PLC				
4,300 % éch. 19/08/2028 (d)(e)	$	200	128	0,04
4,375 % éch. 18/01/2038	£	900	828	0,25
4,644 % éch. 01/04/2031	$	200	150	0,05
4,750 % éch. 14/01/2031 (d)(e)		300	191	0,06
5,125 % éch. 06/06/2034	£	500	460	0,14
7,750 % éch. 02/04/2023 (d)(e)	$	400	331	0,10
7,767 % éch. 16/11/2028		900	794	0,24
Telereal Secured Finance PLC				
4,010 % éch. 10/12/2033	£	1 293	1 188	0,37
Telereal Securitisation PLC				
6,165 % éch. 10/12/2033		87	86	0,03
Tesco Property Finance PLC				
5,411 % éch. 13/07/2044		549	495	0,15
5,661 % éch. 13/10/2041		192	177	0,05
5,744 % éch. 13/04/2040		1 688	1 581	0,49
5,801 % éch. 13/10/2040		329	310	0,09
Thames Water Utilities Finance PLC				
2,375 % éch. 22/04/2040		1 100	683	0,21
2,625 % éch. 24/01/2032		300	238	0,07
4,375 % éch. 03/07/2034		3 200	2 820	0,87
5,500 % éch. 11/02/2041		200	189	0,06
TP ICAP Finance PLC				
2,625 % éch. 18/11/2028		2 000	1 474	0,45
5,250 % éch. 29/05/2026		700	648	0,20
Travis Perkins PLC				
3,750 % éch. 17/02/2026		300	266	0,08
Unique Pub Finance Co. PLC				
5,659 % éch. 30/06/2027		1 115	1 101	0,34
7,395 % éch. 28/03/2024		606	606	0,19
United Utilities Water Finance PLC				
1,875 % éch. 03/06/2042		800	486	0,15
2,000 % éch. 03/07/2033		400	301	0,09
University of Oxford				
2,544 % éch. 08/12/2117		1 850	1 047	0,32
Virgin Media Secured Finance PLC				
4,250 % éch. 15/01/2030		700	546	0,17
Virgin Money UK PLC				
3,125 % éch. 22/06/2025		300	284	0,09
4,000 % éch. 25/09/2026		900	836	0,26
4,000 % éch. 03/09/2027		1 235	1 117	0,34
5,125 % éch. 11/12/2030		200	185	0,06
7,875 % éch. 14/12/2028		500	500	0,15
Vodafone Group PLC				
3,000 % éch. 12/08/2056		1 600	978	0,30
3,375 % éch. 08/08/2049		3 100	2 130	0,65
Wellcome Trust Finance PLC				
4,625 % éch. 25/07/2036		500	504	0,15
Wellcome Trust Ltd.				
1,500 % éch. 14/07/2071		5 300	2 316	0,71
4,000 % éch. 09/05/2059		400	374	0,11
Workspace Group PLC				
2,250 % éch. 11/03/2028		450	336	0,10
Yorkshire Housing Finance PLC				
4,125 % éch. 31/10/2044		700	578	0,18
Yorkshire Water Finance PLC				
1,750 % éch. 27/10/2032		715	519	0,16
2,750 % éch. 18/04/2041		500	349	0,11
			138 858	42,72
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Avon Finance PLC				
4,331 % éch. 20/09/2048		787	772	0,24
Great Hall Mortgages PLC				
2,212 % éch. 18/06/2038	€	9	8	0,00
3,675 % éch. 18/03/2039	£	9	9	0,00
Hops Hill PLC				
4,382 % éch. 27/05/2054		415	411	0,13
Mansard Mortgages PLC				
4,172 % éch. 15/12/2049		141	136	0,04
Mortimer BTL PLC				
4,137 % éch. 23/06/2053	£	1 158	£ 1 129	0,35
4,492 % éch. 23/03/2054		786	768	0,24
Newgate Funding PLC				
2,646 % éch. 15/12/2050	€	1 320	1 092	0,33
3,839 % éch. 01/12/2050	£	65	61	0,02
Polaris PLC				
4,222 % éch. 23/12/2058		688	671	0,21
RMAC PLC				
4,206 % éch. 12/06/2046		836	832	0,26
Stratton Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2060		729	723	0,22
Towd Point Mortgage Funding PLC				
4,071 % éch. 20/10/2051		692	688	0,21
Twin Bridges PLC				
4,237 % éch. 12/03/2055		813	795	0,24
			8 095	2,49
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Bon du Trésor britannique				
0,125 % éch. 31/01/2023		7 500	7 485	2,30
1,250 % éch. 31/07/2051		1 200	649	0,20
1,500 % éch. 22/07/2047		3 800	2 322	0,71
1,500 % éch. 31/07/2053		900	517	0,16
1,750 % éch. 22/07/2057		3 800	2 326	0,72
3,250 % éch. 22/01/2044		3 300	2 934	0,90
3,500 % éch. 22/01/2045		1 900	1 751	0,54
4,250 % éch. 07/03/2036		1 900	1 965	0,61
4,250 % éch. 07/12/2046		2 600	2 682	0,83
			22 631	6,97
Total Royaume-Uni			169 584	52,18
ÉTATS-UNIS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
JPMorgan Mortgage Acquisition Trust				
4,794 % éch. 25/05/2036	$	3	2	0,00
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Alexandria Real Estate Equities, Inc.				
2,000 % éch. 18/05/2032		600	383	0,12
Amgen, Inc.				
4,200 % éch. 22/02/2052		62	41	0,01
4,563 % éch. 15/06/2048		600	428	0,13
Anheuser-Busch Cos. LLC				
4,700 % éch. 01/02/2036		165	130	0,04
4,900 % éch. 01/02/2046		500	380	0,12
Apple, Inc.				
3,600 % éch. 31/07/2042	£	1 100	966	0,30
4,450 % éch. 06/05/2044	$	200	158	0,05
AT&T, Inc.				
3,550 % éch. 15/09/2055		200	112	0,03
3,650 % éch. 15/09/2059		120	67	0,02
4,250 % éch. 01/06/2043	£	4 713	3 848	1,18
4,875 % éch. 01/06/2044		3 738	3 323	1,02
Bank of America Corp.				
2,676 % éch. 19/06/2041	$	700	394	0,12
Berkshire Hathaway Finance Corp.				
2,625 % éch. 19/06/2059	£	100	64	0,02
Booking Holdings, Inc.				
4,500 % éch. 15/11/2031	€	200	180	0,06
Bristol-Myers Squibb Co.				
4,125 % éch. 15/06/2039	$	65	48	0,02
Charter Communications Operating LLC				
5,125 % éch. 01/07/2049		500	316	0,10
Citigroup, Inc.				
3,878 % éch. 24/01/2039		1 500	1 035	0,32
4,412 % éch. 31/03/2031		500	383	0,12
6,800 % éch. 25/06/2038	£	2 000	2 375	0,73
7,375 % éch. 01/09/2039		100	125	0,04
Comcast Corp.				
1,875 % éch. 20/02/2036		500	354	0,11
Community Preservation Corp.				
2,867 % éch. 01/02/2030	$	1 300	914	0,28
Digital Stout Holding LLC				
3,750 % éch. 17/10/2030	£	200	168	0,05
Duke Energy Corp.				
3,850 % éch. 15/06/2034	€	600	494	0,15

Tableau des investissements Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Eli Lilly & Co.			
1,625 % éch. 14/09/2043	£ 500	£ 303	0,09
Entergy Corp.			
3,750 % éch. 15/06/2050	$ 57	35	0,01
Fiserv, Inc.			
3,000 % éch. 01/07/2031	£ 650	542	0,17
Ford Motor Credit Co. LLC			
2,748 % éch. 14/06/2024	700	663	0,20
4,535 % éch. 06/03/2025	900	858	0,26
Goldman Sachs Group, Inc.			
3,615 % éch. 15/03/2028	$ 65	50	0,02
3,625 % éch. 29/10/2029	£ 1 900	1 697	0,52
4,411 % éch. 23/04/2039	$ 800	577	0,18
7,250 % éch. 10/04/2028	£ 300	323	0,10
Home Depot, Inc.			
3,500 % éch. 15/09/2056	$ 58	36	0,01
JPMorgan Chase & Co.			
1,895 % éch. 28/04/2033	£ 800	602	0,19
3,882 % éch. 24/07/2038	$ 200	139	0,04
5,600 % éch. 15/07/2041	300	250	0,08
McDonald's Corp.			
2,950 % éch. 15/03/2034	£ 400	331	0,10
3,750 % éch. 31/05/2038	500	427	0,13
5,875 % éch. 23/04/2032	100	107	0,03
Merck & Co., Inc.			
2,900 % éch. 10/12/2061	$ 600	320	0,10
Microsoft Corp.			
2,525 % éch. 01/06/2050	100	55	0,02
2,675 % éch. 01/06/2060	600	319	0,10
MidAmerican Energy Co.			
4,250 % éch. 15/07/2049	64	45	0,01
Mondelez International, Inc.			
3,875 % éch. 06/03/2045	£ 100	£ 76	0,02
Morgan Stanley			
5,789 % éch. 18/11/2033	800	802	0,25
MPT Operating Partnership LP			
3,375 % éch. 24/04/2030	1 600	1 049	0,32
3,692 % éch. 05/06/2028	1 400	1 028	0,32
National Fuel Gas Co.			
2,950 % éch. 01/03/2031	$ 159	104	0,03
Nestle Holdings, Inc.			
2,500 % éch. 04/04/2032	£ 1 000	844	0,26
Netflix, Inc.			
3,625 % éch. 15/06/2030	€ 600	491	0,15
Northern States Power Co.			
2,900 % éch. 01/03/2050	$ 300	172	0,05
Oracle Corp.			
6,900 % éch. 09/11/2052 (f)	1 900	1 699	0,52
Pfizer, Inc.			
2,735 % éch. 15/06/2043	£ 2 600	1 902	0,59
Realty Income Corp.			
1,750 % éch. 13/07/2033	1 100	760	0,23
2,500 % éch. 14/01/2042	500	316	0,10
T-Mobile USA, Inc.			
5,200 % éch. 15/01/2033	$ 400	331	0,10
Time Warner Cable LLC			
5,250 % éch. 15/07/2042	£ 2 536	2 047	0,63
United Airlines Pass-Through Trust			
5,875 % éch. 15/04/2029	$ 869	714	0,22
Verizon Communications, Inc.			
1,875 % éch. 03/11/2038	£ 2 700	1 716	0,53
3,125 % éch. 02/11/2035	£ 600	£ 479	0,15
3,375 % éch. 27/10/2036	2 800	2 279	0,70
Walmart, Inc.			
5,250 % éch. 28/09/2035	200	212	0,07
5,625 % éch. 27/03/2034	200	219	0,07
Wells Fargo & Co.			
2,125 % éch. 24/09/2031	400	306	0,09
4,625 % éch. 02/11/2035	1 729	1 592	0,49
4,875 % éch. 29/11/2035	1 500	1 369	0,42
		44 872	13,81
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust			
4,889 % éch. 25/04/2035	$ 151	117	0,04
GSR Mortgage Loan Trust			
3,955 % éch. 25/09/2035	1	1	0,00
Mellon Residential Funding Corp. Mortgage Pass-Through Trust			
4,758 % éch. 15/12/2030	3	3	0,00
Sequoia Mortgage Trust			
3,051 % éch. 20/07/2037 ^	8	5	0,00
		126	0,04
Total États-Unis		45 000	13,85
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BONS DU TRÉSOR BRITANNIQUE			
3,511 % éch. 08/05/2023 (b)(c)	£ 11 900	11 751	3,62
Total des Instruments à court terme		11 751	3,62
Total des Valeurs mobilières		**£ 309 110**	**95,11**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
FICC	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 323	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 29/06/2023	£ (274)	£ 269	£ 269	0,08
Total des Contrats de mise en pension						**£ (274)**	**£ 269**	**£ 269**	**0,08**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Long	03/2023	9	£ (34)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	72	521	0,16
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Buxl à 30 ans mars	Court	03/2023	1	23	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du gouvernement japonais à 10 ans mars	Court	03/2023	4	65	0,02
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Court	03/2023	19	(4)	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Court	03/2023	43	9	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Long	03/2023	11	7	0,00
Contrats à terme standardisés sur bon du Trésor britannique à long terme mars	Long	03/2023	406	(2 342)	(0,72)
				£ (1 755)	(0,54)
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**£ (1 755)**	**(0,54)**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
British Telecommunications PLC	1,000 %	20/06/2028	€ 300	£ (8)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2028	600	(15)	(0,01)
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2024	2 600	195	0,06
				£ 172	0,05

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.IG-38 à 5 ans	1,000 %	20/06/2027	$ 1 750	£ 6	0,00
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000	20/12/2027	20 800	119	0,04
Indice iTraxx Europe Main 37 à 5 ans	1,000	20/06/2027	€ 4 150	34	0,01
Indice iTraxx Europe Main 38 à 5 ans	1,000	20/12/2027	19 600	297	0,09
				£ 456	0,14

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	0,500 %	21/09/2024	£ 2 100	£ 36	0,01
À payer[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2033	23 100	885	0,27
À payer[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2053	35 500	(660)	(0,20)
À recevoir[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250	15/03/2028	10 700	42	0,01
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/12/2026	$ 2 300	(207)	(0,06)
À payer	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,750	15/06/2027	300	(6)	0,00
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,000	16/12/2030	3 700	572	0,18
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,250	16/12/2050	100	31	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,500	18/12/2029	6 400	1 118	0,34
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,625	16/01/2050	100	36	0,01
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,750	21/06/2047	1 300	461	0,14
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	1,750	18/12/2049	400	147	0,05
À recevoir	LIBOR USD à 3 mois	2,000	12/02/2045	6 600	2 305	0,71
À recevoir	EURIBOR EUR à 6 mois	0,250	15/09/2036	€ 1 300	332	0,10
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2025	4 300	82	0,02
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2028	4 000	153	0,05
À recevoir[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,500	15/03/2053	1 900	31	0,01
À payer[3]	EURIBOR EUR à 6 mois	1,750	15/03/2033	3 500	(48)	(0,01)
					£ 5 310	1,64
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**£ 5 938**	**1,83**

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente - Indice iTraxx Europe 37 à 5 ans hors cote	Vente	3,000 %	15/03/2023	1 300	£ (2)	£ 0	0,00

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel[1]	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547 %	07/03/2023	1 400	£ (25)	£ (3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	1 400	(25)	(73)	(0,02)
							£ (50)	£ (76)	(0,02)

(1) Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
JPM	Hochtief AG	5,000 %	20/12/2026	€ 500	£ 86	£ (38)	£ 48	0,01

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	02/2023	€ 150	£ 133	£ 0	£ (1)	£ (1)	0,00
	02/2023	$ 24 011	20 349	409	0	409	0,12
BRC	02/2023	£ 174	€ 197	1	0	1	0,00
MBC	02/2023	€ 1 377	£ 1 205	0	(18)	(18)	(0,01)
	02/2023	£ 417	€ 472	3	0	3	0,00
	02/2023	960	$ 1 144	1	(11)	(10)	0,00
	02/2023	¥ 10 400	£ 64	0	(2)	(2)	0,00
	02/2023	$ 2 912	2 455	36	0	36	0,01
MYI	02/2023	£ 295	€ 341	8	0	8	0,00
	02/2023	413	$ 502	4	0	4	0,00
	02/2023	$ 621	£ 505	0	(10)	(10)	0,00
SCX	02/2023	436	358	0	(4)	(4)	0,00
SSB	02/2023	€ 21 531	18 897	0	(239)	(239)	(0,07)
UAG	02/2023	528	458	0	(12)	(12)	0,00
				£ 462	£ (297)	£ 165	0,05

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**£ 137**	**0,04**
Total des Investissements	**£ 313 699**	**96,52**
Autres actifs et passifs à court terme	**£ 11 321**	**3,48**
Actif net	**£ 325 020**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Titre à rémunération en nature.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(e) Titre convertible conditionnel.

(f) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : néant) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Oracle Corp.	6,900 %	09/11/2052	07/11/2022	£ 1 656	£ 1 699	0,52

Des titres d'une juste valeur globale de 0 £ (31 décembre 2021 : 514 £) ont été nantis en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 0 £ (21 décembre 2021 : 58 £) a été reçu en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 10 123 £ (31 décembre 2021 : 12 076 £) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	£ 0	£ 309 110	£ 0	£ 309 110
Contrats de mise en pension	0	269	0	269
Instruments financiers dérivés[3]	(1 767)	6 087	0	4 320
Totaux	**£ (1 767)**	**£ 315 466**	**£ 0**	**£ 313 699**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	£ 0	£ 403 042	£ 0	£ 403 042
Contrats de mise en pension	0	442	0	442
Instruments financiers dérivés[3]	175	2 439	0	2 614
Totaux	**£ 175**	**£ 405 923**	**£ 0**	**£ 406 098**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	£ 408	£ (510)	£ (102)	£ (2)	£ 0	£ (2)
BRC	1	0	1	(8)	0	(8)
CBK	S/O	S/O	S/O	257	0	257
DUB	S/O	S/O	S/O	(3)	0	(3)
GLM	(76)	0	(76)	2	0	2
HUS	S/O	S/O	S/O	(7)	0	(7)
JPM	48	0	48	80	(90)	(10)
MBC	9	0	9	S/O	S/O	S/O
MYC	S/O	S/O	S/O	(2)	0	(2)
MYI	2	0	2	9	0	9
RBC	S/O	S/O	S/O	(14)	0	(14)
SCX	(4)	0	(4)	(21)	0	(21)
SSB	(239)	0	(239)	S/O	S/O	S/O
UAG	(12)	0	(12)	318	0	318

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	93,60	91,80
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	1,51	2,87
Contrats de mise en pension	0,08	0,10
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	(0,54)	0,03
Instruments financiers dérivés compensés	1,83	0,44
Instruments financiers dérivés hors cote	0,04	0,14
Contrats de prise en pension	S/O	(0,12)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Australie	S/O	0,28
Autriche	S/O	0,02
Belgique	0,19	0,69
Bermudes	S/O	0,21
Brésil	S/O	0,11
Îles Caïmans	S/O	0,47
Danemark	1,23	0,08
Finlande	S/O	0,14
France	5,11	5,34
Allemagne	2,80	2,11
Guernesey, Îles Anglo-normandes	S/O	0,04
Hong Kong	S/O	0,03
Inde	0,05	0,04
Irlande	2,32	1,70
Italie	0,78	1,61
Japon	0,09	0,03
Jersey, Îles Anglo-normandes	2,73	3,61
Luxembourg	1,21	1,80
Île Maurice	S/O	0,16
Mexique	0,13	0,18
Pays-Bas	5,45	6,16
Norvège	0,27	0,10
Singapour	0,33	0,45
Espagne	0,22	0,54
Supranationales	1,18	1,04
Suède	0,16	0,14
Suisse	1,21	1,23
Royaume-Uni	52,18	52,21
États-Unis	13,85	14,15
Instruments à court terme	3,62	S/O
Contrats de mise en pension	0,08	0,10
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	(0,54)	0,03
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,05	0,05

Tableau des investissements Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund (suite)

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,14	0,00
Swaps de taux d'intérêt	1,64	0,39
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,02)	S/O
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,01	0,02
Contrats de change à terme	0,05	0,12
Autres actifs et passifs à court terme	3,48	4,62
Actif net	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Heartland Dental LLC				
8,134 % éch. 30/04/2025	$	6 351	$ 5 885	0,30
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
7,445 % éch. 01/02/2029		2 927	2 832	0,14
Serta Simmons Bedding LLC				
7,743 % - 7,827 % éch. 08/11/2023		3 110	221	0,01
Team Health Holdings, Inc.				
7,134 % éch. 06/02/2024		5 811	4 997	0,25
			13 935	0,70
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BANQUE ET FINANCE				
Alliant Holdings Intermediate LLC				
4,250 % éch. 15/10/2027		5 000	4 486	0,23
6,750 % éch. 15/10/2027		5 000	4 505	0,23
Allied Universal Holdco LLC				
4,625 % éch. 01/06/2028		3 000	2 483	0,13
6,000 % éch. 01/06/2029		4 000	2 908	0,15
Armor Holdco, Inc.				
8,500 % éch. 15/11/2029		7 500	5 643	0,28
Curo Group Holdings Corp.				
7,500 % éch. 01/08/2028		4 000	1 871	0,09
Ford Motor Credit Co. LLC				
2,900 % éch. 16/02/2028		5 000	4 136	0,21
2,900 % éch. 10/02/2029		8 000	6 400	0,32
3,375 % éch. 13/11/2025		5 000	4 529	0,23
3,664 % éch. 08/09/2024		3 000	2 863	0,14
4,000 % éch. 13/11/2030		7 500	6 171	0,31
4,125 % éch. 17/08/2027		5 000	4 487	0,23
4,134 % éch. 04/08/2025		5 000	4 691	0,24
4,542 % éch. 01/08/2026		2 000	1 846	0,09
5,113 % éch. 03/05/2029		3 000	2 723	0,14
5,125 % éch. 16/06/2025		2 500	2 409	0,12
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC				
5,500 % éch. 01/05/2028		2 000	1 709	0,09
6,500 % éch. 01/10/2025		5 353	5 042	0,25
Getty Images, Inc.				
9,750 % éch. 01/03/2027		8 250	8 156	0,41
Greystar Real Estate Partners LLC				
5,750 % éch. 01/12/2025		2 000	1 958	0,10
HAT Holdings LLC				
3,750 % éch. 15/09/2030		2 000	1 473	0,07
Howard Hughes Corp.				
4,125 % éch. 01/02/2029		1 000	839	0,04
4,375 % éch. 01/02/2031		2 750	2 229	0,11
5,375 % éch. 01/08/2028		2 500	2 256	0,11
Intesa Sanpaolo SpA				
5,710 % éch. 15/01/2026		1 000	962	0,05
7,700 % éch. 17/09/2025 (e)(g)		4 000	3 639	0,18
Midcap Financial Issuer Trust				
5,625 % éch. 15/01/2030		2 000	1 622	0,08
6,500 % éch. 01/05/2028		2 000	1 723	0,09
MPT Operating Partnership LP				
3,500 % éch. 15/03/2031		2 000	1 375	0,07
Nationstar Mortgage Holdings, Inc.				
5,125 % éch. 15/12/2030		5 000	3 869	0,20
NCL Finance Ltd.				
6,125 % éch. 15/03/2028		2 000	1 479	0,07
OneMain Finance Corp.				
3,500 % éch. 15/01/2027		4 000	3 317	0,17
4,000 % éch. 15/09/2030		3 000	2 242	0,11
5,375 % éch. 15/11/2029		3 000	2 459	0,12
6,625 % éch. 15/01/2028		1 500	1 384	0,07
6,875 % éch. 15/03/2025		1 000	963	0,05
7,125 % éch. 15/03/2026		3 000	2 859	0,14
Park Intermediate Holdings LLC				
4,875 % éch. 15/05/2029		1 000	848	0,04
5,875 % éch. 01/10/2028		1 500	1 362	0,07
PennyMac Financial Services, Inc.				
5,375 % éch. 15/10/2025		1 000	903	0,05
5,750 % éch. 15/09/2031		2 000	1 589	0,08
Rocket Mortgage LLC				
3,625 % éch. 01/03/2029		1 000	794	0,04
3,875 % éch. 01/03/2031	$	2 000	$ 1 531	0,08
4,000 % éch. 15/10/2033		2 000	1 497	0,08
SBA Communications Corp.				
3,125 % éch. 01/02/2029		10 000	8 333	0,42
Voyager Aviation Holdings LLC				
8,500 % éch. 09/05/2026		1 805	1 433	0,07
			131 996	6,65
INDUSTRIE				
24 Hour Fitness Worldwide, Inc.				
8,000 % éch. 01/06/2022 ^		9 500	25	0,00
Academy Ltd.				
6,000 % éch. 15/11/2027		4 000	3 835	0,19
AdaptHealth LLC				
6,125 % éch. 01/08/2028		3 000	2 762	0,14
Adient Global Holdings Ltd.				
4,875 % éch. 15/08/2026		3 000	2 797	0,14
ADT Security Corp.				
4,875 % éch. 15/07/2032		4 000	3 406	0,17
Advantage Sales & Marketing, Inc.				
6,500 % éch. 15/11/2028		5 000	3 820	0,19
Ahead DB Holdings LLC				
6,625 % éch. 01/05/2028		10 000	8 050	0,41
Ahlstrom-Munksjo Holding Oy				
4,875 % éch. 04/02/2028		4 000	3 256	0,16
Air Canada				
3,875 % éch. 15/08/2026		2 500	2 219	0,11
4,625 % éch. 15/08/2029	CAD	2 750	1 779	0,09
Albertsons Cos., Inc.				
3,500 % éch. 15/03/2029	$	2 000	1 682	0,08
4,625 % éch. 15/01/2027		1 500	1 397	0,07
5,875 % éch. 15/02/2028		1 500	1 429	0,07
Albion Financing SARL				
6,125 % éch. 15/10/2026		4 250	3 796	0,19
Allison Transmission, Inc.				
3,750 % éch. 30/01/2031		5 000	4 119	0,21
Altice Financing S.A.				
5,000 % éch. 15/01/2028		4 000	3 229	0,16
Altice France Holding S.A.				
6,000 % éch. 15/02/2028		5 000	2 962	0,15
10,500 % éch. 15/05/2027		3 000	2 294	0,12
Altice France S.A.				
5,125 % éch. 15/07/2029		4 000	3 006	0,15
5,500 % éch. 15/01/2028		3 750	2 945	0,15
5,500 % éch. 15/10/2029		2 000	1 529	0,08
AMC Networks, Inc.				
4,250 % éch. 15/02/2029		5 000	3 123	0,16
American Airlines Pass-Through Trust				
3,150 % éch. 15/08/2033		1 725	1 432	0,07
3,375 % éch. 01/11/2028		2 190	1 831	0,09
3,650 % éch. 15/08/2030		734	655	0,03
American Airlines, Inc.				
5,500 % éch. 20/04/2026		5 000	4 817	0,24
5,750 % éch. 20/04/2029		9 250	8 471	0,43
Antero Resources Corp.				
5,375 % éch. 01/03/2030		1 500	1 393	0,07
Apache Corp.				
4,875 % éch. 15/11/2027		4 000	3 651	0,18
APi Group DE, Inc.				
4,750 % éch. 15/10/2029		4 000	3 488	0,18
Arches Buyer, Inc.				
4,250 % éch. 01/06/2028		3 500	2 742	0,14
6,125 % éch. 01/12/2028		4 000	3 215	0,16
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC				
3,250 % éch. 01/09/2028		2 000	1 701	0,09
4,000 % éch. 01/09/2029		2 000	1 589	0,08
Ascent Resources Utica Holdings LLC				
5,875 % éch. 30/06/2029		2 000	1 786	0,09
8,250 % éch. 31/12/2028		1 000	982	0,05
ASP Unifrax Holdings, Inc.				
5,250 % éch. 30/09/2028		2 000	1 612	0,08
7,500 % éch. 30/09/2029		2 000	1 272	0,06
At Home Group, Inc.				
4,875 % éch. 15/07/2028		1 500	1 059	0,05
7,125 % éch. 15/07/2029		1 750	1 017	0,05
Athenahealth Group, Inc.				
6,500 % éch. 15/02/2030	$	10 000	$ 7 388	0,37
Atlantia SpA				
1,875 % éch. 12/02/2028	€	8 750	7 786	0,39
Avantor Funding, Inc.				
4,625 % éch. 15/07/2028	$	6 000	5 464	0,28
Axalta Coating Systems LLC				
3,375 % éch. 15/02/2029		5 000	4 132	0,21
B.C. Ltd.				
9,000 % éch. 30/01/2028		2 150	2 104	0,11
B.C. Unlimited Liability Co.				
3,500 % éch. 15/02/2029		2 250	1 933	0,10
3,875 % éch. 15/01/2028		2 000	1 794	0,09
4,000 % éch. 15/10/2030		4 000	3 248	0,16
4,375 % éch. 15/01/2028		2 000	1 794	0,09
Ball Corp.				
2,875 % éch. 15/08/2030		5 000	4 001	0,20
Bath & Body Works, Inc.				
6,625 % éch. 01/10/2030		2 000	1 880	0,09
6,875 % éch. 01/11/2035		3 000	2 672	0,13
9,375 % éch. 01/07/2025		1 438	1 538	0,08
Bausch Health Cos., Inc.				
4,875 % éch. 01/06/2028		2 000	1 276	0,06
5,500 % éch. 01/11/2025		3 500	2 981	0,15
5,750 % éch. 15/08/2027		1 000	682	0,03
11,000 % éch. 30/09/2028		2 750	2 158	0,11
14,000 % éch. 15/10/2030		760	455	0,02
BCPE Empire Holdings, Inc.				
7,625 % éch. 01/05/2027		14 000	12 572	0,63
BCPE Ulysses Intermediate, Inc. (7,750 % en numéraire ou 8,500 % de rémunération en nature)				
7,750 % éch. 01/04/2027 (a)		5 000	3 096	0,16
Bellis Acquisition Co. PLC				
3,250 % éch. 16/02/2026	£	3 000	2 950	0,15
Bellis Finco PLC				
4,000 % éch. 16/02/2027		1 400	1 246	0,06
Black Knight InfoServ LLC				
3,625 % éch. 01/09/2028	$	3 000	2 610	0,13
Block, Inc.				
3,500 % éch. 01/06/2031		5 000	3 996	0,20
Bombardier, Inc.				
6,000 % éch. 15/02/2028		3 000	2 778	0,14
7,125 % éch. 15/06/2026		5 000	4 860	0,24
7,500 % éch. 15/03/2025		1 977	1 962	0,10
7,875 % éch. 15/04/2027		6 000	5 832	0,29
Boxer Parent Co., Inc.				
6,500 % éch. 02/10/2025	€	2 000	2 041	0,10
Boyne USA, Inc.				
4,750 % éch. 15/05/2029	$	2 500	2 216	0,11
Buckeye Partners LP				
4,125 % éch. 01/03/2025		2 000	1 908	0,10
4,500 % éch. 01/03/2028		2 000	1 761	0,09
Builders FirstSource, Inc.				
5,000 % éch. 01/03/2030		5 000	4 439	0,22
CAB SELAS				
3,375 % éch. 01/02/2028	€	5 000	4 305	0,22
Cablevision Lightpath LLC				
5,625 % éch. 15/09/2028	$	4 000	2 979	0,15
Caesars Entertainment, Inc.				
4,625 % éch. 15/10/2029		9 000	7 340	0,37
8,125 % éch. 01/07/2027		2 000	1 969	0,10
Callon Petroleum Co.				
7,500 % éch. 15/06/2030		2 500	2 291	0,12
Cargo Aircraft Management, Inc.				
4,750 % éch. 01/02/2028		1 000	909	0,05
Carnival Corp.				
4,000 % éch. 01/08/2028		5 000	4 087	0,21
5,750 % éch. 01/03/2027		4 000	2 863	0,14
6,000 % éch. 01/05/2029		2 500	1 671	0,08
7,625 % éch. 01/03/2026		4 000	3 177	0,16
Carnival PLC				
1,000 % éch. 28/10/2029	€	7 500	3 342	0,17
Carvana Co.				
4,875 % éch. 01/09/2029	$	2 000	773	0,04
5,500 % éch. 15/04/2027		2 000	795	0,04
Catalent Pharma Solutions, Inc.				
2,375 % éch. 01/03/2028	€	2 000	1 749	0,09

Tableau des investissements Fonds US High Yield Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
3,125 % éch. 15/02/2029	$	6 000	$ 4 785	0,24
CCO Holdings LLC				
4,250 % éch. 01/02/2031		10 000	8 044	0,41
4,250 % éch. 15/01/2034		3 000	2 220	0,11
4,500 % éch. 15/08/2030		10 000	8 284	0,42
4,500 % éch. 01/05/2032		10 000	7 979	0,40
4,500 % éch. 01/06/2033		10 000	7 692	0,39
4,750 % éch. 01/03/2030		5 000	4 324	0,22
5,000 % éch. 01/02/2028		2 000	1 820	0,09
5,375 % éch. 01/06/2029		4 000	3 626	0,18
CDI Escrow Issuer, Inc.				
5,750 % éch. 01/04/2030		2 000	1 796	0,09
Central Garden & Pet Co.				
4,125 % éch. 15/10/2030		5 000	4 115	0,21
Charles River Laboratories International, Inc.				
3,750 % éch. 15/03/2029		2 000	1 772	0,09
4,000 % éch. 15/03/2031		1 000	866	0,04
Cheniere Energy Partners LP				
4,500 % éch. 01/10/2029		2 000	1 803	0,09
Cheniere Energy, Inc.				
4,625 % éch. 15/10/2028		2 000	1 812	0,09
Chesapeake Energy Corp.				
6,750 % éch. 15/04/2029		7 500	7 312	0,37
Chobani LLC				
4,625 % éch. 15/11/2028		2 000	1 744	0,09
Churchill Downs, Inc.				
4,750 % éch. 15/01/2028		5 000	4 482	0,23
Clarios Global LP				
4,375 % éch. 15/05/2026	€	5 000	4 948	0,25
6,250 % éch. 15/05/2026	$	1 750	1 713	0,09
Clarivate Science Holdings Corp.				
4,875 % éch. 01/07/2029		5 000	4 258	0,21
Clear Channel International BV				
6,625 % éch. 01/08/2025		2 000	1 912	0,10
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc.				
5,125 % éch. 15/08/2027		3 000	2 606	0,13
7,750 % éch. 15/04/2028		5 000	3 657	0,18
Cloud Software Group Holdings, Inc.				
6,500 % éch. 31/03/2029		7 000	5 908	0,30
Clydesdale Acquisition Holdings, Inc.				
8,750 % éch. 15/04/2030		10 000	8 578	0,43
Coherent Corp.				
5,000 % éch. 15/12/2029		4 000	3 455	0,17
CommScope Technologies LLC				
5,000 % éch. 15/03/2027		2 000	1 362	0,07
6,000 % éch. 15/06/2025		1 500	1 368	0,07
CommScope, Inc.				
4,750 % éch. 01/09/2029		4 500	3 636	0,18
6,000 % éch. 01/03/2026		2 500	2 312	0,12
7,125 % éch. 01/07/2028		4 000	2 866	0,14
8,250 % éch. 01/03/2027		3 000	2 330	0,12
Community Health Systems, Inc.				
4,750 % éch. 15/02/2031		5 000	3 640	0,18
5,250 % éch. 15/05/2030		3 000	2 267	0,11
5,625 % éch. 15/03/2027		5 000	4 296	0,22
6,125 % éch. 01/04/2030		3 000	1 491	0,08
6,875 % éch. 01/04/2028		2 250	1 091	0,05
6,875 % éch. 15/04/2029		6 750	3 482	0,18
Comstock Resources, Inc.				
5,875 % éch. 15/01/2030		2 000	1 722	0,09
6,750 % éch. 01/03/2029		4 000	3 617	0,18
Condor Merger Sub, Inc.				
7,375 % éch. 15/02/2030		14 000	11 281	0,57
Connect Finco SARL				
6,750 % éch. 01/10/2026		3 000	2 786	0,14
Consolidated Communications, Inc.				
5,000 % éch. 01/10/2028		2 000	1 478	0,07
Cornerstone Building Brands, Inc.				
6,125 % éch. 15/01/2029		3 000	2 118	0,11
Coty, Inc.				
3,875 % éch. 15/04/2026	€	4 100	4 087	0,21
5,000 % éch. 15/04/2026	$	2 000	1 899	0,10
6,500 % éch. 15/04/2026		1 500	1 442	0,07
Covanta Holding Corp.				
4,875 % éch. 01/12/2029		750	615	0,03
5,000 % éch. 01/09/2030		1 000	810	0,04
Crocs, Inc.				
4,250 % éch. 15/03/2029	$	2 000	$ 1 697	0,09
CSC Holdings LLC				
3,375 % éch. 15/02/2031		4 000	2 615	0,13
4,125 % éch. 01/12/2030		2 500	1 770	0,09
4,625 % éch. 01/12/2030		1 000	555	0,03
5,750 % éch. 15/01/2030		6 000	3 397	0,17
6,500 % éch. 01/02/2029		2 000	1 639	0,08
Ctec GmbH				
5,250 % éch. 15/02/2030	€	5 000	4 461	0,22
DaVita, Inc.				
3,750 % éch. 15/02/2031	$	7 000	5 240	0,26
4,625 % éch. 01/06/2030		5 000	4 033	0,20
Dealer Tire LLC				
8,000 % éch. 01/02/2028		5 000	4 407	0,22
Deluxe Corp.				
8,000 % éch. 01/06/2029		3 000	2 471	0,12
Diamond BC BV				
4,625 % éch. 01/10/2029		10 000	8 038	0,40
Diamond Foreign Asset Co. (9,000 % en numéraire ou 9,000 % de rémunération en nature)				
9,000 % éch. 22/04/2027 (a)(h)		115	109	0,01
9,000 % éch. 22/04/2027 (a)		31	29	0,00
Diamond Offshore Drilling, Inc.				
13,000 % éch. 21/12/2026		77	75	0,00
Diamond Sports Group LLC				
5,375 % éch. 15/08/2026		8 000	950	0,05
6,625 % éch. 15/08/2027		5 000	56	0,00
Directv Financing LLC				
5,875 % éch. 15/08/2027		10 000	8 966	0,45
DISH DBS Corp.				
5,250 % éch. 01/12/2026		5 000	4 221	0,21
5,750 % éch. 01/12/2028		4 000	3 200	0,16
5,875 % éch. 15/11/2024		5 000	4 657	0,23
7,750 % éch. 01/07/2026		3 000	2 425	0,12
DISH Network Corp.				
11,750 % éch. 15/11/2027		2 000	2 062	0,10
DKT Finance ApS				
9,375 % éch. 17/06/2023		2 250	2 230	0,11
DT Midstream, Inc.				
4,125 % éch. 15/06/2029		4 000	3 444	0,17
4,375 % éch. 15/06/2031		2 500	2 101	0,11
Element Solutions, Inc.				
3,875 % éch. 01/09/2028		3 000	2 555	0,13
Encino Acquisition Partners Holdings LLC				
8,500 % éch. 01/05/2028		3 000	2 746	0,14
Endo DAC				
6,000 % éch. 30/06/2028 ^		8 000	440	0,02
Endurance International Group Holdings, Inc.				
6,000 % éch. 15/02/2029		7 000	4 821	0,24
Energizer Holdings, Inc.				
4,375 % éch. 31/03/2029		2 000	1 699	0,09
4,750 % éch. 15/06/2028		2 000	1 736	0,09
EnLink Midstream LLC				
5,625 % éch. 15/01/2028		5 000	4 769	0,24
6,500 % éch. 01/09/2030		2 500	2 478	0,12
EnLink Midstream Partners LP				
4,150 % éch. 01/06/2025		1 987	1 881	0,09
EQM Midstream Partners LP				
4,000 % éch. 01/08/2024		1 123	1 081	0,05
4,500 % éch. 15/01/2029		3 000	2 524	0,13
4,750 % éch. 15/01/2031		3 000	2 458	0,12
6,000 % éch. 01/07/2025		735	711	0,04
6,500 % éch. 01/07/2027		2 000	1 915	0,10
6,500 % éch. 15/07/2048		2 500	1 878	0,09
Fertitta Entertainment LLC				
4,625 % éch. 15/01/2029		2 000	1 695	0,09
6,750 % éch. 15/01/2030		7 000	5 659	0,29
Ford Motor Co.				
3,250 % éch. 12/02/2032		4 000	3 007	0,15
6,100 % éch. 19/08/2032		2 500	2 313	0,12
Foundation Building Materials, Inc.				
6,000 % éch. 01/03/2029		11 000	8 285	0,42
Frontier Communications Holdings LLC				
5,000 % éch. 01/05/2028		2 000	1 748	0,09
5,875 % éch. 15/10/2027		2 000	1 862	0,09
6,750 % éch. 01/05/2029		4 000	3 315	0,17
Gap, Inc.				
3,625 % éch. 01/10/2029	$	3 000	$ 2 120	0,11
3,875 % éch. 01/10/2031		1 000	699	0,04
Garda World Security Corp.				
4,625 % éch. 15/02/2027		1 500	1 327	0,07
6,000 % éch. 01/06/2029		5 000	4 069	0,21
GFL Environmental, Inc.				
3,500 % éch. 01/09/2028		5 000	4 402	0,22
4,000 % éch. 01/08/2028		5 000	4 282	0,22
5,125 % éch. 15/12/2026		1 000	958	0,05
Global Medical Response, Inc.				
6,500 % éch. 01/10/2025		10 000	7 173	0,36
Go Daddy Operating Co. LLC				
3,500 % éch. 01/03/2029		7 000	5 869	0,30
Golden Entertainment, Inc.				
7,625 % éch. 15/04/2026		2 500	2 468	0,12
Graham Packaging Co., Inc.				
7,125 % éch. 15/08/2028		5 000	4 180	0,21
Graphic Packaging International LLC				
3,500 % éch. 01/03/2029		5 000	4 280	0,22
H-Food Holdings LLC				
8,500 % éch. 01/06/2026		9 000	5 234	0,26
Hadrian Merger Sub, Inc.				
8,500 % éch. 01/05/2026		9 000	7 967	0,40
Herens Holdco SARL				
4,750 % éch. 15/05/2028		3 000	2 246	0,11
Herens Midco SARL				
5,250 % éch. 15/05/2029	€	6 000	4 469	0,23
Hertz Corp.				
4,625 % éch. 01/12/2026	$	2 000	1 678	0,08
5,000 % éch. 01/12/2029		1 000	760	0,04
Hilton Domestic Operating Co., Inc.				
3,625 % éch. 15/02/2032		5 000	4 013	0,20
3,750 % éch. 01/05/2029		2 000	1 733	0,09
4,000 % éch. 01/05/2031		3 000	2 516	0,13
5,750 % éch. 01/05/2028		1 500	1 458	0,07
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC				
4,875 % éch. 01/07/2031		3 000	2 452	0,12
5,000 % éch. 01/06/2029		2 500	2 153	0,11
Howard Midstream Energy Partners LLC				
6,750 % éch. 15/01/2027		2 750	2 639	0,13
Howmet Aerospace, Inc.				
5,950 % éch. 01/02/2037		2 000	1 945	0,10
iHeartCommunications, Inc.				
4,750 % éch. 15/01/2028		5 000	4 080	0,21
6,375 % éch. 01/05/2026		500	461	0,02
8,375 % éch. 01/05/2027		8 750	7 459	0,38
IHO Verwaltungs GmbH (4,750 % en numéraire ou 5,500 % de rémunération en nature)				
4,750 % éch. 15/09/2026 (a)		2 000	1 734	0,09
IHO Verwaltungs GmbH (6,000 % en numéraire ou 6,750 % de rémunération en nature)				
6,000 % éch. 15/05/2027 (a)		2 000	1 759	0,09
IHO Verwaltungs GmbH (6,375 % en numéraire ou 7,125 % de rémunération en nature)				
6,375 % éch. 15/05/2029 (a)		1 750	1 482	0,07
Imola Merger Corp.				
4,750 % éch. 15/05/2029		5 000	4 348	0,22
Ingevity Corp.				
3,875 % éch. 01/11/2028		5 000	4 308	0,22
Innophos Holdings, Inc.				
9,375 % éch. 15/02/2028		8 000	7 864	0,40
Intelligent Packaging Holdco Issuer LP (9,000 % en numéraire ou 9,750 % de rémunération en nature)				
9,000 % éch. 15/01/2026 (a)		3 000	2 111	0,11
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc.				
6,000 % éch. 15/09/2028		4 000	3 234	0,16
Intelsat Jackson Holdings S.A.				
6,500 % éch. 15/03/2030		11 249	10 085	0,51
IQVIA, Inc.				
5,000 % éch. 15/10/2026		5 000	4 785	0,24
Iris Holdings, Inc. (8,750 % en numéraire ou 9,500 % de rémunération en nature)				
8,750 % éch. 15/02/2026 (a)		3 750	3 225	0,16
Jeld-Wen, Inc.				
4,625 % éch. 15/12/2025		2 000	1 678	0,08
4,875 % éch. 15/12/2027		1 000	754	0,04
Kronos Acquisition Holdings, Inc.				
7,000 % éch. 31/12/2027		4 000	3 295	0,17

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
LABL, Inc.				
5,875 % éch. 01/11/2028	$	2 125	$ 1 855	0,09
6,750 % éch. 15/07/2026		2 000	1 888	0,10
8,250 % éch. 01/11/2029		3 000	2 395	0,12
10,500 % éch. 15/07/2027		3 250	3 029	0,15
Laboratoire Eimer Selas				
5,000 % éch. 01/02/2029	€	500	410	0,02
Lamb Weston Holdings, Inc.				
4,125 % éch. 31/01/2030	$	2 000	1 769	0,09
4,875 % éch. 15/05/2028		2 000	1 899	0,10
LBM Acquisition LLC				
6,250 % éch. 15/01/2029		8 000	5 101	0,26
Legacy LifePoint Health LLC				
4,375 % éch. 15/02/2027		4 000	3 390	0,17
Level 3 Financing, Inc.				
3,750 % éch. 15/07/2029		5 000	3 604	0,18
LifePoint Health, Inc.				
5,375 % éch. 15/01/2029		10 000	5 664	0,29
Madison IAQ LLC				
4,125 % éch. 30/06/2028		3 000	2 513	0,13
5,875 % éch. 30/06/2029		4 000	2 749	0,14
MajorDrive Holdings LLC				
6,375 % éch. 01/06/2029		3 000	2 243	0,11
Marriott Ownership Resorts, Inc.				
4,500 % éch. 15/06/2029		3 250	2 701	0,14
6,125 % éch. 15/09/2025		375	387	0,02
Mattel, Inc.				
3,375 % éch. 01/04/2026		3 000	2 762	0,14
3,750 % éch. 01/04/2029		2 000	1 760	0,09
5,875 % éch. 15/12/2027		4 000	3 931	0,20
Mauser Packaging Solutions Holding Co.				
5,500 % éch. 15/04/2024		2 000	1 949	0,10
7,250 % éch. 15/04/2025		5 000	4 634	0,23
Medline Borrower LP				
3,875 % éch. 01/04/2029		7 000	5 654	0,28
5,250 % éch. 01/10/2029		7 250	5 771	0,29
Merlin Entertainments Ltd.				
5,750 % éch. 15/06/2026		2 000	1 876	0,09
Michaels Cos., Inc.				
5,250 % éch. 01/05/2028		3 000	2 417	0,12
7,875 % éch. 01/05/2029		2 500	1 675	0,08
Midwest Gaming Borrower LLC				
4,875 % éch. 01/05/2029		5 000	4 261	0,21
Motion Bondco DAC				
6,625 % éch. 15/11/2027		1 000	862	0,04
MPH Acquisition Holdings LLC				
5,750 % éch. 01/11/2028		5 000	3 336	0,17
MSCI, Inc.				
3,625 % éch. 01/09/2030		3 000	2 499	0,13
3,875 % éch. 15/02/2031		2 000	1 666	0,08
4,000 % éch. 15/11/2029		3 000	2 618	0,13
Nabors Industries, Inc.				
7,375 % éch. 15/05/2027		2 000	1 940	0,10
9,000 % éch. 01/02/2025		2 156	2 186	0,11
NCL Corp. Ltd.				
3,625 % éch. 15/12/2024		5 000	4 280	0,22
5,875 % éch. 15/03/2026		4 000	3 149	0,16
7,750 % éch. 15/02/2029		2 500	1 885	0,09
NCR Corp.				
5,000 % éch. 01/10/2028		1 750	1 495	0,08
5,125 % éch. 15/04/2029		3 000	2 514	0,13
5,250 % éch. 01/10/2030		2 000	1 653	0,08
NESCO Holdings, Inc.				
5,500 % éch. 15/04/2029		2 250	1 972	0,10
Noble Finance Co. (11,000 % en numéraire ou 15,000 % de rémunération en nature)				
11,000 % éch. 15/02/2028 (a)		1 171	1 303	0,07
Nokia Oyj				
6,625 % éch. 15/05/2039		3 000	2 853	0,14
Novelis Corp.				
3,250 % éch. 15/11/2026		3 000	2 693	0,14
3,875 % éch. 15/08/2031		7 000	5 724	0,29
4,750 % éch. 30/01/2030		5 000	4 444	0,22
NuStar Logistics LP				
5,750 % éch. 01/10/2025		2 000	1 926	0,10
6,375 % éch. 01/10/2030		2 000	1 853	0,09
Occidental Petroleum Corp.				
5,500 % éch. 01/12/2025 (h)		4 000	3 992	0,20
6,375 % éch. 01/09/2028	$	2 000	$ 2 022	0,10
6,450 % éch. 15/09/2036		4 000	4 089	0,21
6,600 % éch. 15/03/2046		3 000	3 094	0,16
6,625 % éch. 01/09/2030		2 500	2 589	0,13
7,500 % éch. 01/05/2031		1 000	1 070	0,05
8,875 % éch. 15/07/2030		3 625	4 099	0,21
Olympus Water U.S. Holding Corp.				
3,875 % éch. 01/10/2028	€	1 500	1 305	0,07
4,250 % éch. 01/10/2028	$	7 000	5 692	0,29
5,375 % éch. 01/10/2029	€	10 000	7 783	0,39
6,250 % éch. 01/10/2029	$	2 000	1 521	0,08
ON Semiconductor Corp.				
3,875 % éch. 01/09/2028		2 500	2 186	0,11
Organon & Co.				
4,125 % éch. 30/04/2028		5 000	4 436	0,22
5,125 % éch. 30/04/2031		4 000	3 471	0,17
Outfront Media Capital LLC				
4,250 % éch. 15/01/2029		2 000	1 662	0,08
5,000 % éch. 15/08/2027		2 125	1 916	0,10
Pactiv Evergreen Group Issuer LLC				
4,375 % éch. 15/10/2028		3 000	2 684	0,14
Pactiv Evergreen Group Issuer, Inc.				
4,000 % éch. 15/10/2027		5 000	4 443	0,22
Park River Holdings, Inc.				
5,625 % éch. 01/02/2029		7 000	4 670	0,24
6,750 % éch. 01/08/2029		5 000	3 438	0,17
Performance Food Group, Inc.				
4,250 % éch. 01/08/2029		3 000	2 603	0,13
5,500 % éch. 15/10/2027		1 500	1 418	0,07
6,875 % éch. 01/05/2025		1 000	1 004	0,05
Permian Resources Operating LLC				
5,375 % éch. 15/01/2026		5 000	4 559	0,23
PetSmart, Inc.				
4,750 % éch. 15/02/2028		8 500	7 711	0,39
7,750 % éch. 15/02/2029		5 000	4 705	0,24
Post Holdings, Inc.				
4,500 % éch. 15/09/2031		1 779	1 499	0,08
4,625 % éch. 15/04/2030		5 000	4 324	0,22
5,625 % éch. 15/01/2028		4 000	3 771	0,19
Premier Entertainment Sub LLC				
5,625 % éch. 01/09/2029		3 000	2 216	0,11
Presidio Holdings, Inc.				
4,875 % éch. 01/02/2027		2 500	2 284	0,12
8,250 % éch. 01/02/2028		3 750	3 483	0,18
Prime Security Services Borrower LLC				
3,375 % éch. 31/08/2027		2 000	1 730	0,09
5,250 % éch. 15/04/2024		2 000	1 968	0,10
5,750 % éch. 15/04/2026		1 000	965	0,05
6,250 % éch. 15/01/2028		5 000	4 561	0,23
Radiate Holdco LLC				
4,500 % éch. 15/09/2026		2 000	1 473	0,07
6,500 % éch. 15/09/2028		5 000	2 103	0,11
Radiology Partners, Inc.				
9,250 % éch. 01/02/2028		1 500	844	0,04
Real Hero Merger Sub, Inc.				
6,250 % éch. 01/02/2029		5 000	3 434	0,17
Revlon Consumer Products Corp.				
6,250 % éch. 01/08/2024 ^		2 000	105	0,01
Rockcliff Energy LLC				
5,500 % éch. 15/10/2029		6 000	5 497	0,28
Rockies Express Pipeline LLC				
4,800 % éch. 15/05/2030		2 000	1 764	0,09
4,950 % éch. 15/07/2029		2 000	1 801	0,09
Roller Bearing Co. of America, Inc.				
4,375 % éch. 15/10/2029		3 000	2 598	0,13
Rolls-Royce PLC				
3,625 % éch. 14/10/2025		1 000	925	0,05
5,750 % éch. 15/10/2027	£	1 750	1 938	0,10
Royal Caribbean Cruises Ltd.				
4,250 % éch. 01/07/2026	$	5 000	4 048	0,20
5,500 % éch. 31/08/2026		7 000	5 898	0,30
5,500 % éch. 01/04/2028		5 000	3 999	0,20
RP Escrow Issuer LLC				
5,250 % éch. 15/12/2025		2 250	1 721	0,09
Sabre GLBL, Inc.				
7,375 % éch. 01/09/2025		1 000	963	0,05
9,250 % éch. 15/04/2025		1 500	1 497	0,08
Scientific Games Holdings LP				
6,625 % éch. 01/03/2030	$	7 000	$ 5 922	0,30
SCIH Salt Holdings, Inc.				
4,875 % éch. 01/05/2028		5 000	4 300	0,22
6,625 % éch. 01/05/2029		5 000	4 034	0,20
Scripps Escrow, Inc.				
5,375 % éch. 15/01/2031		5 000	4 014	0,20
Seagate HDD Cayman				
9,625 % éch. 01/12/2032		3 043	3 341	0,17
Sensata Technologies BV				
4,000 % éch. 15/04/2029		5 000	4 319	0,22
Sensata Technologies, Inc.				
3,750 % éch. 15/02/2031		4 000	3 297	0,17
Sigma Holdco BV				
7,875 % éch. 15/05/2026		8 000	5 736	0,29
Simmons Foods, Inc.				
4,625 % éch. 01/03/2029		5 000	4 076	0,21
Sinclair Television Group, Inc.				
4,125 % éch. 01/12/2030		2 000	1 502	0,08
5,125 % éch. 15/02/2027		1 000	817	0,04
Sirius XM Radio, Inc.				
3,875 % éch. 01/09/2031		1 000	782	0,04
4,125 % éch. 01/07/2030		3 250	2 689	0,14
5,000 % éch. 01/08/2027		1 000	927	0,05
SM Energy Co.				
6,500 % éch. 15/07/2028		1 500	1 440	0,07
Southwestern Energy Co.				
4,750 % éch. 01/02/2032		1 000	857	0,04
5,375 % éch. 01/02/2029		3 000	2 786	0,14
5,375 % éch. 15/03/2030		3 000	2 742	0,14
Spectrum Brands, Inc.				
3,875 % éch. 15/03/2031		4 000	3 116	0,16
5,500 % éch. 15/07/2030		3 000	2 653	0,13
5,750 % éch. 15/07/2025		2 000	1 980	0,10
Spirit AeroSystems, Inc.				
4,600 % éch. 15/06/2028		5 275	4 268	0,21
7,500 % éch. 15/04/2025		3 250	3 219	0,16
9,375 % éch. 30/11/2029		3 000	3 162	0,16
Spirit Loyalty Cayman Ltd.				
8,000 % éch. 20/09/2025		3 000	3 019	0,15
SRS Distribution, Inc.				
6,000 % éch. 01/12/2029		5 000	3 986	0,20
6,125 % éch. 01/07/2029		5 000	4 049	0,20
Standard Industries, Inc.				
3,375 % éch. 15/01/2031		4 000	3 018	0,15
4,375 % éch. 15/07/2030		2 500	2 043	0,10
4,750 % éch. 15/01/2028		3 500	3 155	0,16
5,000 % éch. 15/02/2027		1 500	1 386	0,07
Staples, Inc.				
7,500 % éch. 15/04/2026		4 000	3 451	0,17
10,750 % éch. 15/04/2027		2 000	1 443	0,07
Station Casinos LLC				
4,500 % éch. 15/02/2028		2 000	1 742	0,09
4,625 % éch. 01/12/2031		1 000	803	0,04
Strathcona Resources Ltd.				
6,875 % éch. 01/08/2026		4 625	3 381	0,17
Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP				
5,875 % éch. 15/05/2025		3 150	2 945	0,15
Summer BC Bidco LLC				
5,500 % éch. 31/10/2026		4 000	3 251	0,16
Superior Plus LP				
4,500 % éch. 15/03/2029		3 000	2 569	0,13
SWF Escrow Issuer Corp.				
6,500 % éch. 01/10/2029		2 250	1 307	0,07
Syneos Health, Inc.				
3,625 % éch. 15/01/2029		3 000	2 393	0,12
Team Health Holdings, Inc.				
6,375 % éch. 01/02/2025		12 000	6 934	0,35
TEGNA, Inc.				
4,625 % éch. 15/03/2028		1 000	951	0,05
4,750 % éch. 15/03/2026		1 000	971	0,05
5,000 % éch. 15/09/2029		4 000	3 804	0,19
Tenet Healthcare Corp.				
4,375 % éch. 15/01/2030		4 000	3 469	0,17
5,125 % éch. 01/11/2027		3 500	3 263	0,16
6,125 % éch. 01/10/2028		10 000	8 974	0,45
6,125 % éch. 15/06/2030		5 000	4 773	0,24

Tableau des investissements Fonds US High Yield Bond Fund (suite)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
6,875 % éch. 15/11/2031	$ 4 000	$ 3 610	0,18
TK Elevator Holdco GmbH			
6,625 % éch. 15/07/2028	€ 1 800	1 596	0,08
7,625 % éch. 15/07/2028	$ 4 734	3 873	0,20
TK Elevator U.S. Newco, Inc.			
5,250 % éch. 15/07/2027	3 500	3 114	0,16
TransDigm, Inc.			
4,625 % éch. 15/01/2029	7 000	6 167	0,31
5,500 % éch. 15/11/2027	7 000	6 588	0,33
6,250 % éch. 15/03/2026	1 750	1 730	0,09
Travel + Leisure Co.			
4,625 % éch. 01/03/2030	5 000	4 155	0,21
6,625 % éch. 31/07/2026	3 500	3 430	0,17
Trident TPI Holdings, Inc.			
6,625 % éch. 01/11/2025	2 000	1 747	0,09
9,250 % éch. 01/08/2024	5 000	4 787	0,24
TriNet Group, Inc.			
3,500 % éch. 01/03/2029	5 000	4 118	0,21
Triton Water Holdings, Inc.			
6,250 % éch. 01/04/2029	2 000	1 607	0,08
Triumph Group, Inc.			
6,250 % éch. 15/09/2024	2 500	2 374	0,12
7,750 % éch. 15/08/2025	4 000	3 409	0,17
8,875 % éch. 01/06/2024	1 656	1 688	0,09
Twilio, Inc.			
3,625 % éch. 15/03/2029	3 000	2 441	0,12
3,875 % éch. 15/03/2031	2 500	1 987	0,10
U.S. Acute Care Solutions LLC			
6,375 % éch. 01/03/2026	6 000	5 332	0,27
U.S. Foods, Inc.			
4,750 % éch. 15/02/2029	7 000	6 224	0,31
6,250 % éch. 15/04/2025	2 000	1 982	0,10
U.S. Renal Care, Inc.			
10,625 % éch. 15/07/2027	10 000	2 200	0,11
Uber Technologies, Inc.			
4,500 % éch. 15/08/2029	4 000	3 493	0,18
7,500 % éch. 15/09/2027	1 500	1 504	0,08
United Airlines, Inc.			
4,375 % éch. 15/04/2026	3 000	2 786	0,14
4,625 % éch. 15/04/2029	7 500	6 543	0,33
Univar Solutions USA, Inc.			
5,125 % éch. 01/12/2027	2 500	2 375	0,12
Univision Communications, Inc.			
4,500 % éch. 01/05/2029	7 000	5 867	0,30
6,625 % éch. 01/06/2027	2 000	1 934	0,10
UPC Holding BV			
5,500 % éch. 15/01/2028	3 000	2 667	0,13
Valaris Ltd. (8,250 % en numéraire ou 12,000 % de rémunération en nature)			
8,250 % éch. 30/04/2028 (a)	482	485	0,02
Venture Global Calcasieu Pass LLC			
3,875 % éch. 15/08/2029	5 000	4 384	0,22
4,125 % éch. 15/08/2031	2 500	2 134	0,11
Vertiv Group Corp.			
4,125 % éch. 15/11/2028	7 000	5 958	0,30
ViaSat, Inc.			
5,625 % éch. 15/09/2025	2 500	2 323	0,12
6,500 % éch. 15/07/2028	2 000	1 504	0,08
Viking Cruises Ltd.			
5,875 % éch. 15/09/2027	5 000	4 084	0,21
7,000 % éch. 15/02/2029	4 000	3 315	0,17
Virgin Media Finance PLC			
5,000 % éch. 15/07/2030	5 000	4 019	0,20
Virgin Media Secured Finance PLC			
4,500 % éch. 15/08/2030	5 000	4 186	0,21
5,500 % éch. 15/05/2029	4 000	3 592	0,18
Vmed O2 UK Financing PLC			
4,250 % éch. 31/01/2031	5 000	4 059	0,20
VOC Escrow Ltd.			
5,000 % éch. 15/02/2028	2 250	1 939	0,10
WESCO Distribution, Inc.			
7,125 % éch. 15/06/2025	3 000	3 044	0,15
7,250 % éch. 15/06/2028	4 000	4 061	0,20
Western Midstream Operating LP			
5,450 % éch. 01/04/2044	2 000	1 665	0,08
5,500 % éch. 01/02/2050	4 000	3 302	0,17
Wheel Pros, Inc.			
6,500 % éch. 15/05/2029	5 000	1 775	0,09
White Cap Buyer LLC			
6,875 % éch. 15/10/2028	$ 14 000	$ 12 133	0,61
White Cap Parent LLC (8,250 % en numéraire ou 8,250 % de rémunération en nature)			
8,250 % éch. 15/03/2026 (a)	5 250	4 545	0,23
Williams Scotsman International, Inc.			
4,625 % éch. 15/08/2028	2 750	2 486	0,13
6,125 % éch. 15/06/2025	1 000	992	0,05
WMG Acquisition Corp.			
3,000 % éch. 15/02/2031	3 250	2 602	0,13
3,875 % éch. 15/07/2030	3 000	2 589	0,13
WR Grace Holdings LLC			
4,875 % éch. 15/06/2027	3 000	2 662	0,13
5,625 % éch. 15/08/2029	4 000	3 239	0,16
WW International, Inc.			
4,500 % éch. 15/04/2029	2 500	1 252	0,06
Wyndham Hotels & Resorts, Inc.			
4,375 % éch. 15/08/2028	3 000	2 696	0,14
Wynn Las Vegas LLC			
5,250 % éch. 15/05/2027	3 000	2 712	0,14
5,500 % éch. 01/03/2025	3 000	2 854	0,14
Wynn Macau Ltd.			
5,125 % éch. 15/12/2029	1 500	1 216	0,06
5,500 % éch. 01/10/2027	2 000	1 751	0,09
Wynn Resorts Finance LLC			
5,125 % éch. 01/10/2029	3 000	2 576	0,13
Yum! Brands, Inc.			
3,625 % éch. 15/03/2031	3 000	2 522	0,13
4,625 % éch. 31/01/2032	5 000	4 429	0,22
4,750 % éch. 15/01/2030	2 000	1 838	0,09
6,875 % éch. 15/11/2037	2 000	2 034	0,10
Zayo Group Holdings, Inc.			
4,000 % éch. 01/03/2027	3 000	2 222	0,11
6,125 % éch. 01/03/2028	4 000	2 277	0,11
Ziggo Bond Co. BV			
5,125 % éch. 28/02/2030	2 500	2 023	0,10
Ziggo BV			
4,875 % éch. 15/01/2030	4 200	3 521	0,18
		1 367 755	68,91
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS			
Antero Midstream Partners LP			
5,375 % éch. 15/06/2029	2 500	2 289	0,12
5,750 % éch. 01/03/2027	1 000	947	0,05
Blue Racer Midstream LLC			
7,625 % éch. 15/12/2025	2 000	1 988	0,10
Calpine Corp.			
3,750 % éch. 01/03/2031	5 000	4 032	0,20
4,500 % éch. 15/02/2028	2 500	2 235	0,11
5,125 % éch. 15/03/2028	2 000	1 789	0,09
Clearway Energy Operating LLC			
3,750 % éch. 15/02/2031	10 000	8 315	0,42
Crestwood Midstream Partners LP			
5,625 % éch. 01/05/2027	3 000	2 795	0,14
6,000 % éch. 01/02/2029	2 000	1 838	0,09
CrownRock LP			
5,000 % éch. 01/05/2029	2 000	1 808	0,09
5,625 % éch. 15/10/2025	3 000	2 901	0,15
Embarq Corp.			
7,995 % éch. 01/06/2036	1 000	467	0,02
Endeavor Energy Resources LP			
5,750 % éch. 30/01/2028	5 000	4 796	0,24
Genesis Energy LP			
6,500 % éch. 01/10/2025	2 000	1 915	0,10
7,750 % éch. 01/02/2028	1 000	922	0,05
8,000 % éch. 15/01/2027	2 000	1 892	0,10
High Ridge Brands Co.			
8,875 % éch. 15/03/2025	2 500	41	0,00
Lumen Technologies, Inc.			
4,500 % éch. 15/01/2029	3 000	2 075	0,10
NRG Energy, Inc.			
3,375 % éch. 15/02/2029	2 000	1 616	0,08
3,875 % éch. 15/02/2032	4 000	3 012	0,15
5,250 % éch. 15/06/2029	1 250	1 105	0,06
6,625 % éch. 15/01/2027	838	832	0,04
NSG Holdings LLC			
7,750 % éch. 15/12/2025	822	799	0,04
Sprint Capital Corp.			
6,875 % éch. 15/11/2028	$ 5 000	$ 5 201	0,26
8,750 % éch. 15/03/2032	7 000	8 346	0,42
Sprint LLC			
7,625 % éch. 15/02/2025	5 000	5 173	0,26
Tallgrass Energy Partners LP			
5,500 % éch. 15/01/2028	1 750	1 555	0,08
6,000 % éch. 31/12/2030	2 000	1 732	0,09
7,500 % éch. 01/10/2025	1 000	1 011	0,05
Telecom Italia Capital S.A.			
6,375 % éch. 15/11/2033	2 500	2 049	0,10
7,200 % éch. 18/07/2036	1 500	1 220	0,06
TerraForm Power Operating LLC			
4,750 % éch. 15/01/2030	2 000	1 744	0,09
5,000 % éch. 31/01/2028	2 000	1 803	0,09
		80 243	4,04
Total des Obligations et billets privés		1 579 994	79,60
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
Billets du Trésor américain			
3,125 % éch. 31/08/2027	25 000	24 048	1,21
3,500 % éch. 15/09/2025	50 000	49 008	2,47
3,875 % éch. 30/11/2027	50 700	50 430	2,54
4,125 % éch. 30/09/2027	25 000	25 096	1,26
4,125 % éch. 31/10/2027	9 000	9 034	0,46
4,250 % éch. 15/10/2025	73 000	72 954	3,68
		230 570	11,62
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX			
Banc of America Funding Trust			
3,733 % éch. 20/02/2036 ^	73	66	0,00
Countrywide Alternative Loan Trust			
4,813 % éch. 20/05/2046 ^	57	47	0,00
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust			
5,029 % éch. 25/03/2035	17	13	0,00
5,089 % éch. 25/02/2036 ^	5	2	0,00
Credit Suisse Mortgage Capital Mortgage-Backed Trust			
5,863 % éch. 25/02/2037 ^	350	85	0,01
Deutsche ALT-A Securities, Inc. Mortgage Loan Trust			
5,500 % éch. 25/12/2035 ^	41	33	0,00
GSR Mortgage Loan Trust			
4,124 % éch. 25/04/2035	1	1	0,00
IndyMac Mortgage Loan Trust			
6,000 % éch. 25/07/2037 ^	193	143	0,01
MortgageIT Trust			
5,029 % éch. 25/02/2035	32	31	0,00
Residential Accredit Loans, Inc. Trust			
4,929 % éch. 25/05/2046 ^	81	63	0,00
TBW Mortgage-Backed Trust			
6,470 % éch. 25/09/2036 ^	662	22	0,00
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust			
3,510 % éch. 25/12/2036 ^	162	141	0,01
3,801 % éch. 25/10/2036 ^	94	84	0,01
		731	0,04
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS			
Credit-Based Asset Servicing & Securitization Trust			
2,909 % éch. 25/01/2037 ^	78	25	0,00
ACTIONS			
ACTIONS ORDINAIRES			
SERVICES DE COMMUNICATION			
Clear Channel Outdoor Holdings, Inc. (b)	167 378	176	0,01
iHeartMedia, Inc. « A » (b)	38 621	237	0,01
iHeartMedia, Inc. « B » (b)	29 972	165	0,01
		578	0,03
ÉNERGIE			
CHC Group LLC (b)	3 887	0	0,00
SERVICES FINANCIERS			
DB Investors, Inc. (b)(h)	30	0	0,00
Intelsat Emergence S.A. (b)(h)	152 075	3 650	0,18

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Voyager Aviation Holdings LLC (b)	833	$ 0	0,00
		3 650	0,18
		4 228	0,21
DROITS			
Intelsat Jackson Holdings S.A. - Exp. 05/12/2025	31 850	227	0,01
BONS DE SOUSCRIPTION			
DB Investors, Inc. - Exp. 28/06/2069 (h)	113	0	0,00
TITRES PRIVILÉGIÉS			
Voyager Aviation Holdings LLC 9,500 %	5 000	1 342	0,07

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
INSTRUMENTS À COURT TERME			
BONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN			
4,444 % éch. 21/03/2023 (c)(d)	$ 65 000	64 413	3,25
Total des Instruments à court terme		64 413	3,25
Total des Valeurs mobilières		**$ 1 895 465**	**95,50**
	ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (f)	661 211	6 037	0,30
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (f)	3 327 832	33 125	1,67
Total des Fonds d'investissement		**$ 39 162**	**1,97**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
FICC	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 9 269	Bons du Trésor américain 0,000 % échéance 29/06/2023	$ (9 454)	$ 9 269	$ 9 270	0,47
Total des Contrats de mise en pension						**$ (9 454)**	**$ 9 269**	**$ 9 270**	**0,47**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.HY-38 à 5 ans	5,000 %	20/06/2027	$ 64 350	$ 2 014	0,10
Indice CDX.HY-39 à 5 ans	5,000	20/12/2027	50 000	1 208	0,06
				$ 3 222	0,16
Total des Instruments financiers dérivés compensés				**$ 3 222**	**0,16**

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 1 004	£ 817	$ 0	$ (21)	$ (21)	0,00
BRC	01/2023	10 956	€ 10 263	2	0	2	0,00
JPM	01/2023	£ 6 600	$ 7 969	29	0	29	0,00
MBC	01/2023	€ 54 835	57 471	0	(1 077)	(1 077)	(0,05)
	01/2023	$ 1 012	£ 827	0	(17)	(17)	0,00
	02/2023	CAD 2 315	$ 1 747	38	0	38	0,00
MYI	01/2023	€ 10	10	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 22	€ 21	0	0	0	0,00
	01/2023	20	£ 16	0	0	0	0,00
				$ 69	$ (1 115)	$ (1 046)	(0,05)

Tableau des investissements Fonds US High Yield Bond Fund (suite)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en CHF (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 468	CHF 442	$ 11	$ 0	$ 11	0,00
CBK	01/2023	793	749	17	0	17	0,00
MYI	01/2023	CHF 426	$ 457	0	(4)	(4)	0,00
RBC	01/2023	498	538	0	(1)	(1)	0,00
SCX	01/2023	267	289	0	0	0	0,00
				$ 28	$ (5)	$ 23	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation, Institutions en EUR (couverte) de distribution, Investisseurs en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 379	€ 359	$ 5	$ 0	$ 5	0,00
BPS	01/2023	€ 78	$ 83	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 40	€ 38	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	€ 13 638	$ 14 509	0	(53)	(53)	0,00
	01/2023	$ 121 526	€ 117 217	3 628	0	3 628	0,18
JPM	01/2023	€ 8 100	$ 8 423	0	(225)	(225)	(0,01)
MBC	01/2023	3 365	3 556	0	(36)	(36)	0,00
	01/2023	$ 129 870	€ 123 916	2 436	0	2 436	0,12
SCX	01/2023	123 535	118 686	3 187	0	3 187	0,16
				$ 9 256	$ (314)	$ 8 942	0,45

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en GBP (couverte) de capitalisation et Institutions en GBP (couverte) de distribution :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£ 651	$ 800	$ 17	$ 0	$ 17	0,00
	01/2023	$ 237	£ 193	0	(5)	(5)	0,00
BRC	01/2023	£ 16	$ 20	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 20	£ 17	0	0	0	0,00
JPM	01/2023	16 960	14 045	0	(62)	(62)	0,00
MBC	01/2023	£ 2	$ 2	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 16 828	£ 14 034	70	(13)	57	0,00
MYI	01/2023	20	16	0	0	0	0,00
TOR	01/2023	16 842	14 008	11	0	11	0,00
UAG	01/2023	£ 152	$ 189	5	0	5	0,00
	01/2023	$ 24	£ 20	0	(1)	(1)	0,00
				$ 103	$ (81)	$ 22	0,00

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en SGD (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	$ 80	SGD 110	$ 2	$ 0	$ 2	0,00
BRC	01/2023	SGD 34	$ 25	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 3	SGD 4	0	0	0	0,00
GLM	01/2023	SGD 6	$ 5	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 86	SGD 117	2	0	2	0,00
MBC	01/2023	SGD 308	$ 229	0	(1)	(1)	0,00
	01/2023	$ 86	SGD 117	2	0	2	0,00
				$ 6	$ (2)	$ 4	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ 7 945**	**0,40**
Total des Investissements	**$ 1 955 063**	**98,50**
Autres actifs et passifs à court terme	**$ 29 859**	**1,50**
Actif net	**$ 1 984 922**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* **Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

^ **Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.**

(a) Titre à rémunération en nature.

(b) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(c) Titre à coupon zéro.

(d) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(e) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(f) Affilié au Fonds.

(g) Titre convertible conditionnel.

(h) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,84 %) :

Description de l'émetteur	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
DB Investors, Inc.	18/02/2015	$ 0	$ 0	0,00
DB Investors, Inc. - Exp. 28/06/2069	18/02/2015	0	0	0,00
Diamond Foreign Asset Co, (9,000 % Cash or 9,000 % PIK) 9,000 % éch. 22/04/2027	12/05/2021	115	109	0,01
Intelsat Emergence S.A.	11/02/2014 -02/03/2022	15 552	3 650	0,18
Occidental Petroleum Corp, 5,500 % éch. 01/12/2025	08/12/2020	4 000	3 992	0,20
		$ 19 667	$ 7 751	0,39

Un montant en numéraire de 10 449 $ (31 décembre 2021 : 12 192 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 413	$ 1 889 527	$ 5 525	$ 1 895 465
Fonds d'investissement	39 162	0	0	39 162
Contrats de mise en pension	0	9 269	0	9 269
Instruments financiers dérivés[3]	0	11 167	0	11 167
Totaux	**$ 39 575**	**$ 1 909 963**	**$ 5 525**	**$ 1 955 063**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 13 770	$ 3 560 207	$ 33 943	$ 3 607 920
Fonds d'investissement	255 818	0	0	255 818
Contrats de mise en pension	0	1 473	0	1 473
Instruments financiers dérivés[3]	0	8 133	0	8 133
Totaux	**$ 269 588**	**$ 3 569 813**	**$ 33 943**	**$ 3 873 344**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ 9	$ 0	$ 9	$ 51	$ 0	$ 51
BPS	S/O	S/O	S/O	363	(300)	63
BRC	1	0	1	898	(970)	(72)
CBK	3 592	(3 540)	52	(24)	0	(24)
GLM	2	0	2	9	(20)	(11)
HUS	S/O	S/O	S/O	(14)	0	(14)
JPM	(258)	0	(258)	17	0	17
MBC	1 402	(1 320)	82	S/O	S/O	S/O
MYI	(4)	0	(4)	6	(10)	(4)
RBC	(1)	0	(1)	2 151	(1 720)	431
SCX	3 187	(3 050)	137	1 979	(1 310)	669
TOR	11	(20)	(9)	2 370	(1 490)	880
UAG	4	0	4	315	0	315

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	39,23	33,54
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	56,03	57,25
Autres valeurs mobilières	0,24	1,15
Fonds d'investissement	1,97	6,52
Contrats de mise en pension	0,47	0,04
Instruments financiers dérivés compensés	0,16	0,00
Instruments financiers dérivés hors cote	0,40	0,21

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Crédits consortiaux et cessions	0,70	1,19
Obligations et billets privés	79,60	88,62
Obligations du Trésor américain	11,62	S/O
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	0,04	0,03
Titres adossés à des actifs	0,00	0,00
Actions ordinaires	0,21	0,80
Droits	0,01	S/O
Bons de souscription	0,00	0,00
Titres privilégiés	0,07	0,16
Instruments à court terme	3,25	1,14
Fonds d'investissement	1,97	6,52
Contrats de mise en pension	0,47	0,04
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,16	0,00
Instruments financiers dérivés hors cote		
Swaps de rendement total sur indices	S/O	0,03
Contrats de change à terme	(0,05)	(0,03)
Contrats de change à terme couverts	0,45	0,21
Autres actifs et passifs à court terme	1,50	1,29
Actif net	100,00	100,00

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES			
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS			
Charter Communications Operating LLC			
6,140 % éch. 01/02/2027	$ 89	$ 87	0,02
CommScope, Inc.			
7,634 % éch. 06/04/2026	387	366	0,09
Elanco Animal Health, Inc.			
5,870 % éch. 01/08/2027	1 543	1 485	0,38
Level 3 Financing, Inc.			
6,134 % éch. 01/03/2027	33	31	0,01
MH Sub LLC			
8,134 % éch. 13/09/2024	190	184	0,05
Qatar National Bank QPSC			
5,557 % éch. 06/11/2023	400	399	0,10
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc.			
8,165 % éch. 16/11/2025	2 006	1 896	0,49
Tibco Software, Inc.			
9,180 % éch. 30/03/2029	300	269	0,07
USI, Inc.			
7,980 % éch. 02/12/2026	194	193	0,05
		4 910	1,26
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS			
BANQUE ET FINANCE			
AerCap Ireland Capital DAC			
1,750 % éch. 29/10/2024	3 200	2 945	0,76
4,450 % éch. 01/10/2025	500	481	0,12
Agree LP			
4,800 % éch. 01/10/2032	100	93	0,02
Aircastle Ltd.			
4,400 % éch. 25/09/2023	300	297	0,08
Alexandria Real Estate Equities, Inc.			
3,950 % éch. 15/01/2028	200	188	0,05
Ally Financial, Inc.			
8,000 % éch. 01/11/2031	900	932	0,24
American Homes 4 Rent LP			
4,250 % éch. 15/02/2028	2 000	1 853	0,48
American Tower Corp.			
2,100 % éch. 15/06/2030	200	159	0,04
2,750 % éch. 15/01/2027	2 000	1 816	0,47
3,650 % éch. 15/03/2027	2 300	2 152	0,55
Antares Holdings LP			
2,750 % éch. 15/01/2027	1 600	1 284	0,33
Ares Capital Corp.			
2,875 % éch. 15/06/2027	800	679	0,17
Ares Finance Co. LLC			
3,250 % éch. 15/06/2030	900	745	0,19
4,125 % éch. 30/06/2051	200	151	0,04
Aroundtown S.A.			
5,375 % éch. 21/03/2029	1 200	910	0,23
Aviation Capital Group LLC			
3,500 % éch. 01/11/2027	400	350	0,09
3,875 % éch. 01/05/2023	1 500	1 488	0,38
4,375 % éch. 30/01/2024	100	98	0,03
4,875 % éch. 01/10/2025	1 300	1 227	0,32
Avolon Holdings Funding Ltd.			
2,125 % éch. 21/02/2026	400	345	0,09
2,528 % éch. 18/11/2027	1 301	1 042	0,27
5,500 % éch. 15/01/2026	400	381	0,10
AXIS Specialty Finance PLC			
4,000 % éch. 06/12/2027	200	185	0,05
Banco Daycoval S.A.			
4,250 % éch. 13/12/2024	1 600	1 548	0,40
Banco Mercantil del Norte S.A.			
6,750 % éch. 27/09/2024 (d)(f)	500	489	0,13
Bank of America Corp.			
1,898 % éch. 23/07/2031	3 300	2 540	0,65
2,687 % éch. 22/04/2032	2 200	1 766	0,45
3,194 % éch. 23/07/2030	1 800	1 552	0,40
4,300 % éch. 28/01/2025 (d)	900	784	0,20
Bank of Ireland Group PLC			
6,253 % éch. 16/09/2026	700	695	0,18
Barclays PLC			
4,972 % éch. 16/05/2029	700	659	0,17
8,000 % éch. 15/03/2029 (d)(f)	1 700	1 594	0,41
BGC Partners, Inc.			
4,375 % éch. 15/12/2025	$ 1 100	$ 1 032	0,27
Block Financial LLC			
3,875 % éch. 15/08/2030	1 500	1 316	0,34
BNP Paribas S.A.			
7,750 % éch. 16/08/2029 (d)(f)	700	693	0,18
Brookfield Finance, Inc.			
3,500 % éch. 30/03/2051	400	255	0,07
3,900 % éch. 25/01/2028	1 400	1 286	0,33
Carlyle Finance Subsidiary LLC			
3,500 % éch. 19/09/2029	1 900	1 611	0,41
Citigroup, Inc.			
2,976 % éch. 05/11/2030	1 600	1 349	0,35
3,785 % éch. 17/03/2033 (g)	200	172	0,04
4,075 % éch. 23/04/2029	400	369	0,09
6,270 % éch. 17/11/2033 (g)	2 000	2 070	0,53
Citizens Bank N.A.			
4,575 % éch. 09/08/2028	1 000	967	0,25
Commonwealth Bank of Australia			
3,784 % éch. 14/03/2032 (f)	400	331	0,09
Cooperatieve Rabobank UA			
4,655 % éch. 22/08/2028	400	385	0,10
Corebridge Financial, Inc.			
3,850 % éch. 05/04/2029	900	822	0,21
Corporate Office Properties LP			
2,250 % éch. 15/03/2026	300	263	0,07
2,750 % éch. 15/04/2031	1 400	1 051	0,27
Credit Suisse Group AG			
2,593 % éch. 11/09/2025	400	354	0,09
4,282 % éch. 09/01/2028	1 250	1 038	0,27
6,537 % éch. 12/08/2033	2 750	2 420	0,62
Crown Castle, Inc.			
2,100 % éch. 01/04/2031	500	395	0,10
3,100 % éch. 15/11/2029	900	786	0,20
4,300 % éch. 15/02/2029	600	568	0,15
CubeSmart LP			
3,125 % éch. 01/09/2026	600	552	0,14
Deutsche Bank AG			
2,222 % éch. 18/09/2024	1 000	966	0,25
3,035 % éch. 28/05/2032 (g)	400	304	0,08
3,950 % éch. 27/02/2023	1 600	1 595	0,41
5,966 % éch. 27/02/2023	600	600	0,15
Doric Nimrod Air Alpha Pass-Through Trust			
5,250 % éch. 30/05/2025	114	113	0,03
EPR Properties			
4,500 % éch. 01/06/2027	450	394	0,10
4,750 % éch. 15/12/2026	100	90	0,02
4,950 % éch. 15/04/2028	400	342	0,09
ERP Operating LP			
3,250 % éch. 01/08/2027	100	92	0,02
Extra Space Storage LP			
2,350 % éch. 15/03/2032	400	304	0,08
Fairfax Financial Holdings Ltd.			
2,750 % éch. 29/03/2028	€ 200	187	0,05
4,625 % éch. 29/04/2030	$ 1 400	1 273	0,33
4,850 % éch. 17/04/2028	300	284	0,07
Federal Realty Investment Trust			
3,500 % éch. 01/06/2030	400	343	0,09
Fifth Third Bancorp			
4,772 % éch. 28/07/2030	800	765	0,20
First American Financial Corp.			
4,300 % éch. 01/02/2023	200	200	0,05
Fortress Transportation & Infrastructure Investors LLC			
6,500 % éch. 01/10/2025	259	244	0,06
Freedom Mortgage Corp.			
8,125 % éch. 15/11/2024	900	829	0,21
GAIF Bond Issuer Pty. Ltd.			
3,400 % éch. 30/09/2026	500	460	0,12
Global Atlantic Fin Co.			
3,125 % éch. 15/06/2031	200	147	0,04
4,400 % éch. 15/10/2029	800	671	0,17
GLP Capital LP			
3,350 % éch. 01/09/2024	700	672	0,17
4,000 % éch. 15/01/2031	300	258	0,07
5,750 % éch. 01/06/2028	700	689	0,18
Goldman Sachs Group, Inc.			
2,383 % éch. 21/07/2032	1 500	1 167	0,30
2,615 % éch. 22/04/2032	$ 1 000	$ 800	0,21
3,691 % éch. 05/06/2028	655	610	0,16
Goodman U.S. Finance Three LLC			
3,700 % éch. 15/03/2028	1 100	994	0,26
Great-West Lifeco Finance LP			
4,581 % éch. 17/05/2048	300	248	0,06
Hanover Insurance Group, Inc.			
4,500 % éch. 15/04/2026	800	784	0,20
Highwoods Realty LP			
4,125 % éch. 15/03/2028	500	453	0,12
4,200 % éch. 15/04/2029	200	175	0,05
Host Hotels & Resorts LP			
3,500 % éch. 15/09/2030	1 300	1 076	0,28
4,000 % éch. 15/06/2025	1 233	1 186	0,31
HSBC Capital Funding Dollar LP			
10,176 % éch. 30/06/2030 (d)	400	481	0,12
HSBC Holdings PLC			
2,099 % éch. 04/06/2026	900	820	0,21
2,357 % éch. 18/08/2031	1 600	1 226	0,32
4,292 % éch. 12/09/2026	1 000	958	0,25
4,583 % éch. 19/06/2029	400	369	0,09
5,402 % éch. 11/08/2033	900	836	0,22
6,500 % éch. 15/09/2037	100	97	0,02
6,800 % éch. 01/06/2038	220	219	0,06
Hudson Pacific Properties LP			
4,650 % éch. 01/04/2029	100	86	0,02
Invitation Homes Operating Partnership LP			
2,300 % éch. 15/11/2028	1 300	1 077	0,28
JAB Holdings BV			
2,200 % éch. 23/11/2030	1 600	1 203	0,31
JPMorgan Chase & Co.			
2,182 % éch. 01/06/2028	700	613	0,16
2,545 % éch. 08/11/2032	900	714	0,18
2,580 % éch. 22/04/2032	5 100	4 099	1,04
3,509 % éch. 23/01/2029	1 105	1 005	0,26
3,782 % éch. 01/02/2028	40	37	0,01
4,000 % éch. 01/04/2025 (d)	2 900	2 482	0,64
4,851 % éch. 25/07/2028	1 000	976	0,25
Kilroy Realty LP			
3,050 % éch. 15/02/2030	1 800	1 444	0,37
KKR Group Finance Co. LLC			
3,625 % éch. 25/02/2050	1 100	759	0,20
Lazard Group LLC			
3,625 % éch. 01/03/2027	100	92	0,02
4,500 % éch. 19/09/2028	200	186	0,05
Legg Mason, Inc.			
5,625 % éch. 15/01/2044	200	196	0,05
Life Storage LP			
3,875 % éch. 15/12/2027	800	742	0,19
Lloyds Bank PLC			
0,000 % éch. 02/04/2032	200	122	0,03
Lloyds Banking Group PLC			
4,375 % éch. 22/03/2028	800	761	0,20
4,716 % éch. 11/08/2026	900	881	0,23
4,976 % éch. 11/08/2033	900	829	0,21
Mid-America Apartments LP			
1,100 % éch. 15/09/2026	1 200	1 039	0,27
4,200 % éch. 15/06/2028	400	380	0,10
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.			
2,309 % éch. 20/07/2032	2 000	1 544	0,40
5,133 % éch. 20/07/2033	900	862	0,22
Mizuho Financial Group, Inc.			
3,153 % éch. 16/07/2030	1 873	1 607	0,41
5,345 % éch. 08/09/2024	1 600	1 590	0,41
Morgan Stanley			
4,889 % éch. 20/07/2033	1 400	1 319	0,34
Morgan Stanley Domestic Holdings, Inc.			
4,500 % éch. 20/06/2028	200	195	0,05
MPT Operating Partnership LP			
4,625 % éch. 01/08/2029	500	382	0,10
Muthoot Finance Ltd.			
4,400 % éch. 02/09/2023	1 400	1 379	0,35
Nationstar Mortgage Holdings, Inc.			
5,500 % éch. 15/08/2028	1 188	971	0,25
Nationwide Building Society			
4,000 % éch. 14/09/2026	300	273	0,07

Tableau des investissements Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
NatWest Group PLC				
4,519 % éch. 25/06/2024	$	500	$ 495	0,13
4,892 % éch. 18/05/2029		1 700	1 612	0,41
6,274 % éch. 25/06/2024		400	400	0,10
Neuberger Berman Group LLC				
4,500 % éch. 15/03/2027		1 000	952	0,25
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
2,750 % éch. 09/03/2028		1 900	1 542	0,40
Nomura Holdings, Inc.				
2,679 % éch. 16/07/2030		1 000	802	0,21
5,386 % éch. 06/07/2027		2 100	2 076	0,53
Nykredit Realkredit A/S				
1,500 % éch. 01/10/2053	DKK	9 381	1 029	0,26
Omega Healthcare Investors, Inc.				
4,750 % éch. 15/01/2028	$	1 500	1 385	0,36
5,250 % éch. 15/01/2026		100	98	0,03
Owl Rock Capital Corp.				
2,875 % éch. 11/06/2028		500	393	0,10
Park Aerospace Holdings Ltd.				
4,500 % éch. 15/03/2023		1 400	1 397	0,36
Physicians Realty LP				
4,300 % éch. 15/03/2027		300	283	0,07
Sagax AB				
2,250 % éch. 13/03/2025	€	300	296	0,08
Santander Holdings USA, Inc.				
2,490 % éch. 06/01/2028	$	700	601	0,15
4,400 % éch. 13/07/2027		400	382	0,10
Santander UK Group Holdings PLC				
1,532 % éch. 21/08/2026		1 700	1 499	0,39
SBA Tower Trust				
1,884 % éch. 15/07/2050		1 000	881	0,23
Sberbank of Russia Via SB Capital S.A.				
5,125 % éch. 29/10/2022 ^		2 100	245	0,06
5,250 % éch. 23/05/2023 ^(f)		600	81	0,02
SBL Holdings, Inc.				
5,125 % éch. 13/11/2026		1 000	877	0,23
SELP Finance SARL				
3,750 % éch. 10/08/2027	€	300	298	0,08
SMBC Aviation Capital Finance DAC				
3,550 % éch. 15/04/2024	$	1 100	1 064	0,27
Société Générale S.A.				
6,750 % éch. 06/04/2028 (d)(f)		400	359	0,09
7,375 % éch. 04/10/2023 (d)(f)		300	288	0,07
Spirit Realty LP				
3,200 % éch. 15/02/2031		100	80	0,02
4,000 % éch. 15/07/2029		200	174	0,04
Standard Chartered PLC				
3,265 % éch. 18/02/2036		200	148	0,04
Stifel Financial Corp.				
4,000 % éch. 15/05/2030		600	522	0,13
STORE Capital Corp.				
4,500 % éch. 15/03/2028		200	181	0,05
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
1,474 % éch. 08/07/2025		1 100	1 003	0,26
3,202 % éch. 17/09/2029 (f)		700	602	0,15
TP ICAP Finance PLC				
5,250 % éch. 29/05/2026	£	400	445	0,11
UBS Group AG				
3,126 % éch. 13/08/2030	$	900	765	0,20
UDR, Inc.				
3,000 % éch. 15/08/2031		900	753	0,19
3,100 % éch. 01/11/2034		300	228	0,06
3,500 % éch. 15/01/2028		300	273	0,07
VICI Properties LP				
3,875 % éch. 15/02/2029		300	263	0,07
4,500 % éch. 15/01/2028		100	92	0,02
5,125 % éch. 15/05/2032		600	557	0,14
5,750 % éch. 01/02/2027		100	98	0,03
Vonovia SE				
0,000 % éch. 01/12/2025 (b)	€	3 500	3 279	0,84
Wells Fargo & Co.				
2,393 % éch. 02/06/2028	$	800	707	0,18
3,196 % éch. 17/06/2027		4 400	4 087	1,05
4,897 % éch. 25/07/2033		2 100	2 000	0,51
Weyerhaeuser Co.				
4,000 % éch. 15/04/2030		1 300	1 187	0,31
7,375 % éch. 15/03/2032	$	343	$ 380	0,10
			142 838	36,76
INDUSTRIE				
Adani Transmission Step-One Ltd.				
4,000 % éch. 03/08/2026		400	357	0,09
Adventist Health System				
5,430 % éch. 01/03/2032		300	296	0,08
Air Canada Pass-Through Trust				
3,300 % éch. 15/07/2031		795	681	0,18
3,750 % éch. 15/06/2029		137	120	0,03
5,250 % éch. 01/10/2030		299	283	0,07
Alaska Airlines Pass-Through Trust				
4,800 % éch. 15/02/2029		675	643	0,17
Alcon Finance Corp.				
2,600 % éch. 27/05/2030		500	426	0,11
Allegion U.S. Holding Co., Inc.				
3,550 % éch. 01/10/2027		1 100	995	0,26
Amdocs Ltd.				
2,538 % éch. 15/06/2030		1 600	1 299	0,33
American Airlines Pass-Through Trust				
3,200 % éch. 15/12/2029		648	563	0,14
3,250 % éch. 15/04/2030		721	562	0,14
3,375 % éch. 01/11/2028		375	314	0,08
3,500 % éch. 15/08/2033		432	329	0,08
3,575 % éch. 15/07/2029		143	128	0,03
3,600 % éch. 15/04/2031		227	178	0,05
4,000 % éch. 15/01/2027		436	379	0,10
ArcelorMittal S.A.				
6,800 % éch. 29/11/2032		1 000	997	0,26
Ashtead Capital, Inc.				
4,000 % éch. 01/05/2028		400	365	0,09
AstraZeneca PLC				
4,000 % éch. 17/01/2029		500	481	0,12
Atlantia SpA				
1,875 % éch. 12/02/2028	€	100	89	0,02
BAE Systems PLC				
3,400 % éch. 15/04/2030	$	200	177	0,05
Baptist Healthcare System Obligated Group				
3,540 % éch. 15/08/2050		300	217	0,06
BAT International Finance PLC				
1,668 % éch. 25/03/2026		600	532	0,14
Bayer U.S. Finance LLC				
4,250 % éch. 15/12/2025		1 100	1 067	0,27
5,779 % éch. 15/12/2023		900	898	0,23
Berry Global, Inc.				
1,570 % éch. 15/01/2026		1 500	1 338	0,34
Boardwalk Pipelines LP				
3,400 % éch. 15/02/2031		500	419	0,11
Boeing Co.				
5,930 % éch. 01/05/2060		700	641	0,16
British Airways Pass-Through Trust				
4,125 % éch. 20/03/2033		289	242	0,06
4,250 % éch. 15/05/2034		215	193	0,05
Broadcom, Inc.				
3,469 % éch. 15/04/2034		569	456	0,12
Cameron LNG LLC				
3,302 % éch. 15/01/2035		1 400	1 132	0,29
CDW LLC				
3,569 % éch. 01/12/2031		700	578	0,15
Centene Corp.				
2,450 % éch. 15/07/2028		1 100	931	0,24
Charter Communications Operating LLC				
4,200 % éch. 15/03/2028		1 300	1 197	0,31
Cheniere Energy Partners LP				
3,250 % éch. 31/01/2032		400	318	0,08
4,000 % éch. 01/03/2031		2 100	1 791	0,46
Cloud Software Group Holdings, Inc.				
6,500 % éch. 31/03/2029		100	84	0,02
Continental Airlines Pass-Through Trust				
4,000 % éch. 29/04/2026		221	211	0,05
Continental Resources, Inc.				
5,750 % éch. 15/01/2031		400	373	0,10
CVS Health Corp.				
4,125 % éch. 01/04/2040		900	753	0,19
CVS Pass-Through Trust				
5,789 % éch. 10/01/2026	$	42	$ 42	0,01
6,036 % éch. 10/12/2028		143	141	0,04
DAE Funding LLC				
1,625 % éch. 15/02/2024		1 950	1 852	0,48
Daimler Trucks Finance North America LLC				
4,779 % éch. 14/06/2023		2 500	2 497	0,64
DaVita, Inc.				
4,625 % éch. 01/06/2030		2 200	1 774	0,46
Dell International LLC				
6,020 % éch. 15/06/2026		1 050	1 073	0,28
6,200 % éch. 15/07/2030		900	917	0,24
Delta Air Lines Pass-Through Trust				
2,000 % éch. 10/12/2029		936	798	0,21
Directv Financing LLC				
5,875 % éch. 15/08/2027		1 100	986	0,25
Eastern Gas Transmission & Storage, Inc.				
3,900 % éch. 15/11/2049		2 300	1 635	0,42
eHi Car Services Ltd.				
7,000 % éch. 21/09/2026		700	435	0,11
Energy Transfer LP				
4,250 % éch. 15/03/2023		740	738	0,19
4,400 % éch. 15/03/2027		1 400	1 332	0,34
5,750 % éch. 15/02/2033		1 000	980	0,25
5,950 % éch. 01/10/2043		100	92	0,02
6,500 % éch. 01/02/2042		100	99	0,03
Enterprise Products Operating LLC				
5,700 % éch. 15/02/2042		300	292	0,08
ERAC USA Finance LLC				
3,300 % éch. 01/12/2026		1 000	929	0,24
Expedia Group, Inc.				
5,000 % éch. 15/02/2026		1 300	1 284	0,33
Ferguson Finance PLC				
3,250 % éch. 02/06/2030		300	255	0,07
Flex Ltd.				
4,750 % éch. 15/06/2025		300	295	0,08
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A.				
5,150 % éch. 11/02/2026		900	698	0,18
Global Payments, Inc.				
2,900 % éch. 15/05/2030		600	493	0,13
Greene King Finance PLC				
5,318 % éch. 15/09/2031	£	114	128	0,03
GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC				
3,375 % éch. 24/03/2029	$	2 400	2 163	0,56
HCA, Inc.				
3,500 % éch. 15/07/2051		700	452	0,12
Health & Happiness H&H International Holdings Ltd.				
5,625 % éch. 24/10/2024		600	533	0,14
Humana, Inc.				
5,875 % éch. 01/03/2033		800	828	0,21
Hyundai Capital America				
2,000 % éch. 15/06/2028		1 600	1 306	0,34
Illumina, Inc.				
5,750 % éch. 13/12/2027		900	913	0,23
Imperial Brands Finance PLC				
3,875 % éch. 26/07/2029		1 500	1 286	0,33
4,250 % éch. 21/07/2025		500	478	0,12
Incitec Pivot Finance LLC				
3,950 % éch. 03/08/2027		500	452	0,12
Infor, Inc.				
1,750 % éch. 15/07/2025		600	543	0,14
JetBlue Pass-Through Trust				
2,750 % éch. 15/11/2033		260	214	0,05
4,000 % éch. 15/05/2034		87	78	0,02
Kansas City Southern				
3,125 % éch. 01/06/2026		300	282	0,07
Kinder Morgan, Inc.				
4,800 % éch. 01/02/2033		300	279	0,07
Kraft Heinz Foods Co.				
6,875 % éch. 26/01/2039		550	599	0,15
Las Vegas Sands Corp.				
2,900 % éch. 25/06/2025		1 500	1 380	0,35
3,900 % éch. 08/08/2029		600	507	0,13
Leidos, Inc.				
4,375 % éch. 15/05/2030		600	543	0,14

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Marriott International, Inc.				
3,500 % éch. 15/10/2032	$	200	$ 167	0,04
Marvell Technology, Inc.				
4,200 % éch. 22/06/2023		390	388	0,10
Melco Resorts Finance Ltd.				
4,875 % éch. 06/06/2025		1 300	1 196	0,31
5,250 % éch. 26/04/2026		600	529	0,14
MGM China Holdings Ltd.				
5,250 % éch. 18/06/2025		900	847	0,22
5,375 % éch. 15/05/2024		200	193	0,05
Micron Technology, Inc.				
4,663 % éch. 15/02/2030		950	864	0,22
Mitchells & Butlers Finance PLC				
6,013 % éch. 15/12/2030	£	432	486	0,12
Moody's Corp.				
3,250 % éch. 20/05/2050	$	900	626	0,16
Motorola Solutions, Inc.				
2,300 % éch. 15/11/2030		300	235	0,06
Netflix, Inc.				
4,875 % éch. 15/06/2030		400	374	0,10
Newcrest Finance Pty. Ltd.				
5,750 % éch. 15/11/2041		200	183	0,05
Norfolk Southern Corp.				
4,100 % éch. 15/05/2049		45	37	0,01
NVR, Inc.				
3,000 % éch. 15/05/2030		300	253	0,06
NXP BV				
4,875 % éch. 01/03/2024		1 100	1 092	0,28
ONEOK Partners LP				
5,000 % éch. 15/09/2023		200	200	0,05
Oracle Corp.				
4,000 % éch. 15/07/2046		600	440	0,11
4,000 % éch. 15/11/2047		600	441	0,11
6,250 % éch. 09/11/2032 (g)		1 000	1 050	0,27
Pacific National Finance Pty. Ltd.				
4,750 % éch. 22/03/2028		1 700	1 510	0,39
Penske Truck Leasing Co. LP				
4,450 % éch. 29/01/2026		100	96	0,02
Petroleos Mexicanos				
7,690 % éch. 23/01/2050		100	69	0,02
Philip Morris International, Inc.				
5,750 % éch. 17/11/2032		200	205	0,05
Phosagro OAO Via Phosagro Bond Funding DAC				
3,050 % éch. 23/01/2025 ^		400	268	0,07
Sabine Pass Liquefaction LLC				
5,000 % éch. 15/03/2027		300	295	0,08
Sands China Ltd.				
2,800 % éch. 08/03/2027		300	257	0,07
3,350 % éch. 08/03/2029		1 000	818	0,21
3,750 % éch. 08/08/2031		400	315	0,08
Santos Finance Ltd.				
5,250 % éch. 13/03/2029		1 600	1 470	0,38
Spirit AeroSystems, Inc.				
9,375 % éch. 30/11/2029		200	211	0,05
Spirit Airlines Pass-Through Trust				
3,650 % éch. 15/08/2031		452	367	0,09
4,100 % éch. 01/10/2029		122	109	0,03
Syngenta Finance NV				
4,441 % éch. 24/04/2023		1 650	1 643	0,42
T-Mobile USA, Inc.				
2,550 % éch. 15/02/2031		4 300	3 523	0,91
2,875 % éch. 15/02/2031		365	302	0,08
Targa Resources Corp.				
5,200 % éch. 01/07/2027		700	687	0,18
TD SYNNEX Corp.				
1,750 % éch. 09/08/2026		2 300	1 958	0,50
Tencent Music Entertainment Group				
2,000 % éch. 03/09/2030		400	303	0,08
Tennessee Gas Pipeline Co. LLC				
7,000 % éch. 15/10/2028		900	963	0,25
Time Warner Cable LLC				
5,875 % éch. 15/11/2040		1 400	1 225	0,32
Transcontinental Gas Pipe Line Co. LLC				
4,000 % éch. 15/03/2028		900	846	0,22
Transurban Finance Co. Pty. Ltd.				
2,450 % éch. 16/03/2031		150	118	0,03
Trimble, Inc.				
4,150 % éch. 15/06/2023	$	100	$ 99	0,03
U.S. Airways Pass-Through Trust				
5,900 % éch. 01/04/2026		214	207	0,05
United Airlines Pass-Through Trust				
2,700 % éch. 01/11/2033		354	287	0,07
2,875 % éch. 07/04/2030		396	337	0,09
3,100 % éch. 07/04/2030		221	179	0,05
3,700 % éch. 01/09/2031		485	406	0,10
3,750 % éch. 03/03/2028		608	560	0,14
4,000 % éch. 11/10/2027		177	164	0,04
4,150 % éch. 11/10/2025		532	516	0,13
4,550 % éch. 25/02/2033		77	65	0,02
Verisk Analytics, Inc.				
4,125 % éch. 15/03/2029		200	188	0,05
VMware, Inc.				
4,650 % éch. 15/05/2027		350	339	0,09
4,700 % éch. 15/05/2030		900	839	0,22
Warnermedia Holdings, Inc.				
4,279 % éch. 15/03/2032		800	661	0,17
5,050 % éch. 15/03/2042		1 500	1 153	0,30
Waste Connections, Inc.				
4,200 % éch. 15/01/2033		900	839	0,22
Weibo Corp.				
3,375 % éch. 08/07/2030		700	545	0,14
Weir Group PLC				
2,200 % éch. 13/05/2026		1 300	1 154	0,30
Woodside Finance Ltd.				
3,650 % éch. 05/03/2025		1 100	1 057	0,27
Xiaomi Best Time International Ltd.				
2,875 % éch. 14/07/2031		400	290	0,07
Zimmer Biomet Holdings, Inc.				
4,250 % éch. 15/08/2035		228	190	0,05
			92 868	23,90
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS				
AEP Texas, Inc.				
6,650 % éch. 15/02/2033		300	312	0,08
Ameren Illinois Co.				
3,250 % éch. 15/03/2050		400	288	0,07
Appalachian Power Co.				
7,000 % éch. 01/04/2038		900	1 008	0,26
CenterPoint Energy, Inc.				
4,250 % éch. 01/11/2028		90	85	0,02
Clearway Energy Operating LLC				
3,750 % éch. 15/02/2031		200	166	0,04
Cleveland Electric Illuminating Co.				
3,500 % éch. 01/04/2028		1 561	1 425	0,37
Consolidated Edison Co. of New York, Inc.				
5,300 % éch. 01/03/2035		900	887	0,23
Dominion Energy, Inc.				
5,375 % éch. 15/11/2032		100	99	0,03
DTE Energy Co.				
2,950 % éch. 01/03/2030		600	511	0,13
Duke Energy Carolinas LLC				
6,000 % éch. 15/01/2038		50	53	0,01
Edison International				
6,950 % éch. 15/11/2029		100	105	0,03
EDP Finance BV				
6,300 % éch. 11/10/2027		900	927	0,24
Enel Finance America LLC				
7,100 % éch. 14/10/2027		600	621	0,16
Entergy Corp.				
1,900 % éch. 15/06/2028		200	169	0,04
Entergy Mississippi LLC				
2,850 % éch. 01/06/2028		700	623	0,16
Exelon Corp.				
4,050 % éch. 15/04/2030		800	745	0,19
FirstEnergy Transmission LLC				
4,350 % éch. 15/01/2025		500	488	0,13
Greenko Solar Mauritius Ltd.				
5,550 % éch. 29/01/2025		500	472	0,12
India Green Energy Holdings				
5,375 % éch. 29/04/2024		250	241	0,06
Interstate Power & Light Co.				
3,600 % éch. 01/04/2029		1 400	1 283	0,33
Ipalco Enterprises, Inc.				
3,700 % éch. 01/09/2024	$	1 500	$ 1 454	0,37
Jersey Central Power & Light Co.				
4,300 % éch. 15/01/2026		1 100	1 064	0,27
Mississippi Power Co.				
3,950 % éch. 30/03/2028		500	470	0,12
NiSource, Inc.				
3,600 % éch. 01/05/2030		300	268	0,07
ONEOK, Inc.				
4,350 % éch. 15/03/2029		200	185	0,05
4,550 % éch. 15/07/2028		200	189	0,05
6,100 % éch. 15/11/2032		500	502	0,13
Pacific Gas & Electric Co.				
2,100 % éch. 01/08/2027		2 300	1 968	0,51
3,000 % éch. 15/06/2028		900	780	0,20
3,150 % éch. 01/01/2026		100	93	0,02
3,750 % éch. 01/07/2028		300	267	0,07
4,250 % éch. 15/03/2046 ^		1 100	769	0,20
4,300 % éch. 15/03/2045 ^		100	71	0,02
PECO Energy Co.				
3,000 % éch. 15/09/2049		100	69	0,02
Progress Energy, Inc.				
7,750 % éch. 01/03/2031		204	232	0,06
Rio Oil Finance Trust				
8,200 % éch. 06/04/2028		213	216	0,06
Southern California Edison Co.				
2,850 % éch. 01/08/2029		800	697	0,18
3,900 % éch. 01/12/2041		108	82	0,02
4,200 % éch. 01/03/2029		200	191	0,05
6,650 % éch. 01/04/2029		2 035	2 104	0,54
Southern Co. Gas Capital Corp.				
3,250 % éch. 15/06/2026		2 700	2 517	0,65
Southwest Gas Corp.				
5,800 % éch. 01/12/2027		1 000	1 014	0,26
Sprint LLC				
7,875 % éch. 15/09/2023		400	406	0,10
Systems Energy Resources, Inc.				
2,140 % éch. 09/12/2025		800	732	0,19
Targa Resources Partners LP				
5,500 % éch. 01/03/2030		300	283	0,07
Transcanada Trust				
5,300 % éch. 15/03/2077		50	42	0,01
			27 173	6,99
Total des Obligations et billets privés			262 879	67,65
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA				
3,000 % éch. 01/02/2053		3 300	2 899	0,75
3,500 % éch. 01/02/2053		4 640	4 219	1,09
4,000 % éch. 01/02/2053		13 400	12 572	3,23
5,000 % éch. 01/02/2053		100	99	0,02
			19 789	5,09
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Obligations du Trésor américain				
2,500 % éch. 15/02/2045		7 300	5 503	1,42
2,875 % éch. 15/05/2052		2 600	2 084	0,54
3,250 % éch. 15/05/2042		2 764	2 425	0,62
3,375 % éch. 15/08/2042		2 800	2 503	0,65
4,000 % éch. 15/11/2042 (h)		13 700	13 417	3,45
Billets du Trésor américain				
2,750 % éch. 15/08/2032		1 900	1 730	0,45
2,875 % éch. 15/05/2032		6 301	5 809	1,49
			33 471	8,62
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust				
5,318 % éch. 15/10/2037		835	803	0,21
Countrywide Alternative Loan Trust				
3,398 % éch. 25/08/2035 ^		36	30	0,01
Countrywide Home Loan Reperforming REMIC Trust				
4,540 % éch. 25/11/2034		173	164	0,04
			997	0,26

Tableau des investissements Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 5,319 % éch. 25/02/2036 ^	$	210	$ 198	0,05
Citigroup Mortgage Loan Trust 4,589 % éch. 25/01/2037		1 133	533	0,14
Ellington Loan Acquisition Trust 5,489 % éch. 25/05/2037		209	201	0,05
Long Beach Mortgage Loan Trust 5,364 % éch. 25/07/2034		961	945	0,24
New Century Home Equity Loan Trust 5,094 % éch. 25/02/2036		182	151	0,04
			2 028	0,52
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi 3,125 % éch. 16/04/2030		600	558	0,14
Export-Import Bank of India 3,250 % éch. 15/01/2030		400	348	0,09
Obligation internationale du gouvernement italien 6,875 % éch. 27/09/2023		600	604	0,16
Obligation internationale du gouvernement péruvien 8,200 % éch. 12/08/2026	PEN	7 800	2 142	0,55
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 2,800 % éch. 23/06/2030	$	300	263	0,07
Obligation internationale du gouvernement roumain 3,750 % éch. 07/02/2034	€	400	320	0,08
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	62 900	3 908	1,01
Obligation internationale du gouvernement ukrainien 7,750 % éch. 01/09/2024 ^	$	300	75	0,02
			8 218	2,12

DESCRIPTION	ACTIONS	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
ACTIONS ORDINAIRES			
SERVICES FINANCIERS			
Stearns Holdings LLC « B » (a)	14 062	$ 0	0,00
BONS DE SOUSCRIPTION			
Guaranteed Rate, Inc. - Exp. 31/12/2060	68	0	0,00
TITRES PRIVILÉGIÉS			
Wells Fargo & Co. 4,250 % éch. 15/09/2026 (d)	40 800	672	0,17

		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BILLETS DE TRÉSORERIE				
Constellation Brands, Inc. 5,000 % éch. 11/01/2023	$	750	749	0,19
Duke Energy Corp. 4,620 % éch. 17/01/2023		2 000	1 996	0,51
Électricité de France S.A. 5,000 % éch. 20/01/2023		1 000	997	0,26
Entergy Corp. 4,700 % éch. 12/01/2023		3 400	3 394	0,87
Fiserv, Inc. 4,820 % éch. 01/02/2023		1 600	1 593	0,41
McCormick & Co., Inc. 4,750 % éch. 27/01/2023		500	498	0,13

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
National Grid Holdings Ltd. 4,810 % éch. 24/01/2023	$	900	$ 897	0,23
Quanta Services, Inc. 5,100 % éch. 13/01/2023		500	499	0,13
VW Credit, Inc. 4,750 % éch. 24/01/2023		500	499	0,13
Walgreens Boots Alliance, Inc. 4,900 % éch. 11/01/2023		1 300	1 298	0,34
			12 420	3,20
BONS DU TRÉSOR HONGROIS				
18,250 % éch. 03/01/2023 (b)(c)	HUF	381 000	1 015	0,26
Total des Instruments à court terme			13 435	3,46
Total des Valeurs mobilières			**$ 346 399**	**89,15**

	ACTIONS		
FONDS D'INVESTISSEMENT			
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (e)	3 883 596	38 657	9,95
Total des Fonds d'investissement		**$ 38 657**	**9,95**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
BOS	4,190 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 12 800	Obligations du Trésor américain 2,875 % échéance 15/05/2049	$ (13 133)	$ 12 800	$ 12 806	3,30
FICC	1,900	30/12/2022	03/01/2023	2 583	Billets du Trésor américain 0,125 % échéance 15/05/2023	(2 635)	2 583	2 583	0,66
Total des Contrats de mise en pension						**$ (15 768)**	**$ 15 383**	**$ 15 389**	**3,96**

(1) Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois décembre	Long	03/2024	27	$ 13	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois mars	Long	06/2023	35	0	0,00
Exercice d'une Option d'achat à 146,000 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	5	4	0,00
Contrats à terme standardisés sur Euro-Bobl mars	Long	03/2023	27	(124)	(0,03)
Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans mars	Court	03/2023	80	731	0,19
Exercice d'une Option de vente à 138,500 EUR sur Contrats à terme standardisés sur obligation Euro-Bund à 10 ans février 2023[1]	Court	01/2023	5	(25)	(0,01)
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à 30 ans mars	Long	03/2023	383	29	0,01
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Long	03/2023	79	62	0,02
				$ 690	0,18
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ 690**	**0,18**

(1) Option de style contrat à terme standardisé.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION[1]

Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Airbus Finance BV	1,000 %	20/12/2025	€ 200	$ (2)	0,00
American International Group, Inc.	1,000	20/12/2026	$ 500	(7)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2023	2 200	1	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2023	1 400	(15)	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/06/2024	1 100	2	0,00
AT&T, Inc.	1,000	20/12/2026	900	(14)	0,00
Barclays Bank PLC	1,000	20/12/2023	€ 1 500	3	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2023	$ 500	(1)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2025	200	2	0,00
Boeing Co.	1,000	20/12/2026	500	(2)	0,00
Boeing Co.	1,000	20/06/2027	2 900	120	0,03
BP Capital Markets PLC	1,000	20/12/2025	€ 700	(7)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2024	400	(4)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2025	200	(2)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/12/2027	300	(4)	0,00
British Telecommunications PLC	1,000	20/06/2028	1 100	(31)	(0,01)
Devon Energy Corp.	1,000	20/12/2026	$ 800	4	0,00
DISH DBS Corp.	5,000	20/06/2023	200	(14)	0,00
Enbridge, Inc.	1,000	20/12/2026	900	(4)	0,00
Exelon Generation Co. LLC	1,000	20/12/2024	1 600	3	0,00
Expedia Group, Inc.	1,000	20/12/2026	300	(5)	0,00
Ford Motor Co.	5,000	20/12/2024	1 300	(92)	(0,02)
General Electric Co.	1,000	20/12/2023	500	8	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2024	300	7	0,00
General Electric Co.	1,000	20/06/2026	1 200	(4)	0,00
General Electric Co.	1,000	20/12/2026	200	(1)	0,00
General Motors Co.	5,000	20/12/2026	1 900	(172)	(0,05)
Hess Corp.	1,000	20/12/2026	1 200	2	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20/12/2023	200	(3)	0,00
MetLife, Inc.	1,000	20/12/2024	1 400	(18)	(0,01)
National Rural Utilities Cooperative Finance Corp.	1,000	20/12/2026	200	0	0,00
Rolls-Royce PLC	1,000	20/12/2024	€ 2 300	273	0,06
Southwest Airlines Co.	1,000	20/12/2026	$ 550	3	0,00
Telefonica Emisiones S.A.	1,000	20/06/2028	€ 800	(15)	0,00
Tesco PLC	1,000	20/12/2024	1 000	(17)	(0,01)
Tesco PLC	1,000	20/12/2027	2 400	(42)	(0,01)
Tesco PLC	1,000	20/06/2028	500	(13)	0,00
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/06/2026	$ 1 200	(26)	(0,01)
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2026	1 800	(42)	(0,01)
Verizon Communications, Inc.	1,000	20/12/2027	1 400	13	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20/06/2023	€ 100	(2)	0,00
Vodafone Group PLC	1,000	20/06/2024	200	(4)	0,00
Volkswagen International Finance NV	1,000	20/06/2028	1 600	(54)	(0,01)
				$ (176)	(0,05)

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	1,000 %				
		20/12/2027	$ 48 800	$ (117)	(0,03)

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT

Taux variable à payer/ à recevoir	Indice de taux variable	Taux fixe	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
À payer		1,101 %	21/02/2052	£ 200	$ (101)	(0,03)
	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour					
À payer	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	1,175	28/02/2052	500	(243)	(0,06)
À recevoir[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,000	15/03/2033	3 200	(76)	(0,02)
À recevoir[3]	SONIO GBP composé-OIS à 1 jour	2,250	15/03/2028	700	25	0,01
À recevoir	MUTKCALM JPY composé-OIS à 1 jour	0,300	20/03/2028	¥ 231 200	81	0,02
À recevoir	Taux de financement au jour le jour garanti-USD composé-OIS à 1 jour	1,000	15/06/2027	$ 24 500	722	0,19
À payer	CDI BRL à 1 an	11,665	04/01/2027	BRL 16 400	(81)	(0,02)
À payer	CDI BRL à 1 an	12,980	04/01/2027	19 200	40	0,01
À payer	LIBOR USD à 3 mois	1,270	04/11/2023	$ 25 600	(472)	(0,12)
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,195	25/04/2027	ZAR 22 300	41	0,01
À recevoir	JIBAR ZAR à 3 mois	7,300	28/04/2027	3 900	6	0,00
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	0,550	10/08/2024	€ 1 600	(69)	(0,02)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	13/05/2027	3 300	(292)	(0,08)
À payer	EURIBOR EUR à 6 mois	1,000	18/05/2027	1 500	(132)	(0,03)
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,000	19/09/2023	HUF 115 000	(41)	(0,01)
À payer	BBR HUF à 6 mois	1,250	19/09/2023	352 100	(133)	(0,03)
À payer	TIIE MXN à 28 jours	6,015	03/06/2026	MXN 93 700	(431)	(0,11)
					$ (1 156)	(0,29)
Total des Instruments financiers dérivés compensés					**$ (1 449)**	**(0,37)**

Tableau des investissements Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund (suite)

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

(3) Cet instrument a une date d'entrée en vigueur différée. Pour de plus amples informations, voir la note 2, Transactions sur titres et produits de placement, des Notes relatives aux États financiers.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

OPTIONS ACHETÉES

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,000 %	15/03/2023	2 310	$ 263	$ 1 252	0,32
JPM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	0,000	15/03/2023	1 540	170	834	0,22
							$ 433	$ 2 086	0,54

OPTIONS VENDUES

SWAPTIONS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT

Contrepartie	Description	Achat/vente de protection	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
GST	Option de vente - Indice iTraxx Europe 37 à 5 ans hors cote	Vente	3,000 %	15/03/2023	700	$ (2)	$ 0	0,00

SWAPTIONS DE TAUX D'INTÉRÊT

Contrepartie	Description	Indice de taux variable	Taux variable à payer/ à recevoir	Taux d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,870 %	23/01/2023	200	$ (1)	$ (1)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,320	23/01/2023	200	(1)	(3)	0,00
BPS	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,900	17/01/2023	400	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,400	17/01/2023	400	(2)	(7)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,175	15/03/2023	6 930	(257)	(2 130)	(0,56)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,610	17/01/2023	200	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,110	17/01/2023	200	(2)	(6)	0,00
GLM	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,000	12/01/2023	500	(3)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,550	12/01/2023	500	(3)	(4)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,547	07/03/2023	900	(20)	(2)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	2,547	07/03/2023	900	(20)	(57)	(0,02)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À recevoir	2,067	09/06/2023	1 200	(14)	(3)	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	3,140	09/06/2023	1 200	(16)	(39)	(0,01)
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,740	19/01/2023	200	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,180	19/01/2023	200	(2)	(4)	0,00
JPM	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	EURIBOR EUR à 6 mois	À payer	0,175	15/03/2023	4 620	(167)	(1 420)	(0,37)
MYC	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	3,070	23/01/2023	400	(2)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 10 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,520	23/01/2023	400	(2)	(5)	0,00
	Option d'achat - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À recevoir	2,600	17/01/2023	200	(1)	0	0,00
	Option de vente - Swap de taux d'intérêt à 30 ans hors cote	LIBOR USD à 3 mois	À payer	3,050	17/01/2023	200	(1)	(7)	0,00
							$ (520)	$ (3 688)	(0,96)

OPTIONS SUR TITRES

Contrepartie	Description	Prix d'exercice	Date d'expiration	Montant notionnel(1)	Prime	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	$ 101,891	05/01/2023	300	$ (1)	$ 0	0,00
JPM	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/03/2053	97,156	06/03/2023	900	(8)	(14)	(0,01)
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	98,766	06/03/2023	200	(2)	(3)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/03/2053	100,766	06/03/2023	200	(1)	(1)	0,00
SAL	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/01/2053	101,859	05/01/2023	400	(1)	0	0,00
	Option de vente - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	99,750	06/02/2023	400	(3)	(2)	0,00
	Option d'achat - Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme hors cote (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	101,750	06/02/2023	400	(2)	(1)	0,00
					$ (18)	$ (21)	(0,01)

(1) Le Montant notionnel représente le nombre de contrats.

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR ÉMISSIONS PRIVÉES, SOUVERAINES ET MUNICIPALES AMÉRICAINES - VENTE DE PROTECTION(1)

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel(2)	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BOA	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000 %	20/06/2026	$ 100	$ (4)	$ 1	$ (3)	0,00
BRC	Alibaba Group Holding Ltd.	1,000	20/12/2024	400	5	(3)	2	0,00
	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	2 100	(51)	61	10	0,01
	NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1,000	20/12/2025	500	11	(4)	7	0,00

Contrepartie	Entité de référence	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
	Pertamina Persero PT	1,000 %	20/12/2024	$ 400	$ (2)	$ 6	$ 4	0,00
DUB	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2025	300	0	4	4	0,00
FBF	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	700	(11)	19	8	0,00
GLM	Obligation internationale du gouvernement italien	1,000	20/06/2025	2 300	(26)	63	37	0,01
GST	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	200	(2)	3	1	0,00
	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2025	300	0	4	4	0,00
JPM	Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite	1,000	20/06/2025	400	0	6	6	0,00
MYC	Obligation internationale du gouvernement brésilien	1,000	20/06/2027	1 000	(62)	11	(51)	(0,01)
	Brookfield Asset Management, Inc.	1,000	20/06/2025	300	0	(4)	(4)	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2024	100	(1)	2	1	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2026	200	1	(1)	0	0,00
	Obligation internationale du gouvernement mexicain	1,000	20/12/2027	400	(14)	9	(5)	0,00
					$ (156)	$ 177	$ 21	0,01

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - VENTE DE PROTECTION[1]

Contrepartie	Indices/Tranches	Taux fixe à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Primes payées/(reçues)	Plus-value/ (moins-value) latente	Juste valeur	En % de l'actif net
BPS	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000 %	20/12/2023	$ 100	$ 12	$ (8)	$ 4	0,00
CBK	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000	20/12/2023	100	10	(6)	4	0,00
GST	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000	20/12/2023	400	48	(30)	18	0,01
JPM	Indice CDX.HY-31 à 5 ans 25-35 %	5,000	20/12/2023	300	33	(20)	13	0,00
					$ 103	$ (64)	$ 39	0,01

(1) Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	AUD	115	$	78	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	DKK	8 400		1 175	0	(32)	(32)	(0,01)
	01/2023	£	977		1 191	15	0	15	0,00
	01/2023	$	212	€	200	1	0	1	0,00
	01/2023	ZAR	18 945	$	1 067	0	(45)	(45)	(0,01)
	02/2023	$	185	IDR	2 912 102	3	0	3	0,00
	02/2023		337	NOK	3 340	3	0	3	0,00
	02/2023	ZAR	2 423	$	135	0	(7)	(7)	0,00
	03/2023	$	132	IDR	2 071 812	2	0	2	0,00
	03/2023	ZAR	10 172	$	576	0	(18)	(18)	(0,01)
BPS	01/2023	HUF	85 162		222	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	$	206	€	193	1	0	1	0,00
	01/2023		190	ZAR	3 304	4	0	4	0,00
	01/2023	ZAR	9 717	$	555	0	(15)	(15)	0,00
	02/2023	$	70	IDR	1 093 522	1	0	1	0,00
	03/2023		69	INR	5 696	0	0	0	0,00
	03/2023		2 311	MXN	46 575	46	0	46	0,01
BRC	01/2023		212	€	201	2	0	2	0,00
	02/2023		510	NOK	5 094	8	0	8	0,00
CBK	01/2023		579	BRL	3 040	0	(3)	(3)	0,00
	01/2023		951	PEN	3 819	48	0	48	0,01
	02/2023	PEN	6 834	$	1 714	0	(73)	(73)	(0,02)
	03/2023	MXN	2 380		121	1	0	1	0,00
	03/2023	PEN	8 086		2 093	0	(14)	(14)	0,00
	04/2023		16 317		4 079	0	(164)	(164)	(0,03)
	05/2023	MXN	14 695		727	0	(10)	(10)	0,00
	09/2023	ZAR	10 952		620	0	(11)	(11)	0,00
CLY	01/2023	HUF	296 031		752	0	(36)	(36)	(0,01)
DUB	01/2023		11 316		25	0	(5)	(5)	0,00
GLM	01/2023	BRL	3 040		570	0	(5)	(5)	0,00
	01/2023	COP	4 152 103		856	1	0	1	0,00
	01/2023	ZAR	2 476		138	0	(7)	(7)	0,00
	03/2023	$	1 430	CLP	1 302 772	85	0	85	0,02
	03/2023		845	COP	4 152 103	0	0	0	0,00
	03/2023		2	MXN	34	0	0	0	0,00
	04/2023		560	BRL	3 040	5	0	5	0,00
	05/2023		4 022	PEN	16 005	131	0	131	0,03
	05/2023	ZAR	202	$	12	0	0	0	0,00
JPM	02/2023	MXN	36 253		1 768	0	(76)	(76)	(0,02)
	02/2023	$	120	IDR	1 888 776	2	0	2	0,00
	02/2023	ZAR	5 444	$	303	0	(16)	(16)	0,00
	03/2023	$	147	MXN	2 925	1	0	1	0,00

Tableau des investissements Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund (suite)

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
MYI	01/2023	€	1 351	$	1 441	$ 0	$ (1)	$ (1)	0,00
	01/2023	£	123		148	0	0	0	0,00
	01/2023	$	863	AUD	1 285	9	0	9	0,00
	01/2023		156	£	129	0	0	0	0,00
	01/2023	ZAR	5 436	$	303	0	(16)	(16)	0,00
	03/2023	$	185	IDR	2 906 138	3	0	3	0,00
SCX	01/2023	€	4 370	$	4 548	0	(117)	(117)	(0,03)
	01/2023	$	95	AUD	141	1	0	1	0,00
	01/2023		740	PEN	2 858	9	0	9	0,00
	02/2023		126	IDR	1 987 412	2	0	2	0,00
SSB	01/2023	PEN	2 858	$	741	0	(9)	(9)	0,00
	01/2023	$	810	COP	4 152 103	45	0	45	0,01
	01/2023		740	PEN	2 858	9	0	9	0,00
						$ 438	$ (685)	$ (247)	(0,06)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€	1 361	$	1 431	$ 0	$ (22)	$ (22)	(0,01)
	01/2023	$	1 744	€	1 650	18	0	18	0,00
BPS	01/2023		10		9	0	0	0	0,00
BRC	01/2023	€	3 527	$	3 760	0	(6)	(6)	0,00
	01/2023	$	41	€	39	0	0	0	0,00
CBK	01/2023	€	14	$	15	0	0	0	0,00
	01/2023	$	40 912	€	39 451	1 210	0	1 210	0,31
JPM	01/2023		34 896		33 558	935	0	935	0,24
MYI	01/2023		15		14	0	0	0	0,00
RYL	01/2023		14 955		14 282	294	0	294	0,08
SCX	01/2023		42 056		40 370	1 048	0	1 048	0,27
						$ 3 505	$ (28)	$ 3 477	0,89

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre de la Catégorie Institutions en GBP (couverte) de distribution II :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer		Devise à recevoir		Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	£	447	$	543	$ 6	$ 0	$ 6	0,01
	01/2023	$	6 248	£	5 173	0	(25)	(25)	(0,01)
BPS	01/2023		325		269	0	(1)	(1)	0,00
BRC	01/2023	£	23	$	29	1	0	1	0,00
	01/2023	$	874	£	715	0	(14)	(14)	0,00
GLM	01/2023	£	7	$	8	0	0	0	0,00
JPM	01/2023	$	5 331	£	4 414	0	(21)	(21)	(0,01)
MYI	01/2023	£	24	$	29	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	$	4 388	£	3 677	36	0	36	0,01
						$ 43	$ (61)	$ (18)	0,00

Total des Instruments financiers dérivés hors cote	**$ 1 649**	**0,42**

TITRES VENDUS À DÉCOUVERT

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN			
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA			
2,000 % éch. 01/01/2053	$ 2 500	$ (2 035)	(0,52)
Total des Titres vendus à découvert		**$ (2 035)**	**(0,52)**
Total des Investissements		**$ 399 294**	**102,77**
Autres actifs et passifs à court terme		**$ (10 772)**	**(2,77)**
Actif net		**$ 388 522**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre n'a pas généré de revenus au cours des douze derniers mois.

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Échéance perpétuelle ; la date indiquée, le cas échéant, représente la prochaine date contractuelle d'achat.

(e) Affilié au Fonds.

(f) Titre convertible conditionnel.

(g) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,72 %) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Citigroup, Inc.	3,785 %	17/03/2033	10/03/2022	$ 200	$ 172	0,04
Citigroup, Inc.	6,270	17/11/2033	09/11/2022	2 000	2 070	0,53
Deutsche Bank AG	3,035	28/05/2032	21/06/2021	405	304	0,08
Oracle Corp.	6,250	09/11/2032	07/11/2022	998	1 050	0,27
				$ 3 603	$ 3 596	0,92

(h) Un titre d'une juste valeur globale de 12 732 $ (31 décembre 2021 : 26 228 $) a été nanti ou livré en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 11 785 $ (31 décembre 2021 : 15 901 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 830 $ (31 décembre 2021 : 830 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 672	$ 345 328	$ 399	$ 346 399
Fonds d'investissement	38 657	0	0	38 657
Contrats de mise en pension	0	15 383	0	15 383
Instruments financiers dérivés[3]	587	303	0	890
Titres vendus à découvert	0	(2 035)	0	(2 035)
Totaux	**$ 39 916**	**$ 358 979**	**$ 399**	**$ 399 294**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 1 017	$ 880 499	$ 10	$ 881 526
Fonds d'investissement	6 571	0	0	6 571
Contrats de mise en pension	0	686	0	686
Instruments financiers dérivés[3]	258	7 482	0	7 740
Titres vendus à découvert	0	(3 780)	0	(3 780)
Totaux	**$ 7 846**	**$ 884 887**	**$ 10**	**$ 892 743**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos en cours au 31 décembre 2022 :

Contrepartie	Taux d'emprunt	Date de règlement	Date d'échéance	Montant emprunté	À payer sur opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos[1]	En % de l'actif net
BPG	(1,500) %	30/12/2022	03/01/2023	$ (12 886)	$ (12 884)	(3,32)
	(1,350)	29/12/2022	30/12/2022	(12 824)	(12 823)	(3,30)
	(1,000)	28/12/2022	29/12/2022	(12 948)	(12 948)	(3,33)
Total des Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos					**$ (38 655)**	**(9,95)**

(1) Le montant à payer sur les opérations par vente et rachat dos-à-dos comprend 1 $ de baisse de prix différée.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BOA	$ (108)	$ 0	$ (108)	$ (75)	$ 140	$ 65
BPS	(856)	740	(116)	3 392	(2 720)	672

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
BRC	$ 14	$ 0	$ 14	$ 800	$ (610)	$ 190
CBK	988	(750)	238	134	0	134
CLY	(36)	0	(36)	S/O	S/O	S/O
DUB	(1)	0	(1)	39	0	39
FBF	8	0	8	12	0	12
GLM	138	0	138	(743)	600	(143)
GST	23	0	23	91	0	91
JPM	240	(170)	70	1 961	(1 390)	571
MYC	(71)	90	19	(10)	90	80
MYI	(5)	(10)	(15)	25	0	25
RYL	294	0	294	1	0	1
SAL	(3)	0	(3)	(13)	0	(13)
SCX	979	(930)	49	3 500	(2 840)	660
SSB	45	0	45	40	0	40

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	59,33	71,45
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	29,34	27,82
Autres valeurs mobilières	0,48	1,12
Fonds d'investissement	9,95	0,75
Contrats de mise en pension	3,96	0,08
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,18	0,03
Instruments financiers dérivés compensés	(0,37)	(0,19)
Instruments financiers dérivés hors cote	0,42	1,04
Titres vendus à découvert	(0,52)	(0,43)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	(9,95)	(3,02)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Crédits consortiaux et cessions	1,26	1,85
Obligations et billets privés	67,65	85,36
Agences du gouvernement américain	5,09	1,41
Obligations du Trésor américain	8,62	9,92
Titres adossés à des créances hypothécaires non émis par des organismes gouvernementaux	0,26	0,03
Titres adossés à des actifs	0,52	0,27
Émissions souveraines	2,12	1,37
Actions ordinaires	0,00	0,00
Bons de souscription	0,00	0,00
Titres privilégiés	0,17	0,12
Instruments à court terme	3,46	0,06
Fonds d'investissement	9,95	0,75
Contrats de mise en pension	3,96	0,08
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,18	0,03
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	(0,05)	0,07
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	(0,03)	0,03
Swaps de taux d'intérêt	(0,29)	(0,29)
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options achetées		
Swaptions de taux d'intérêt	0,54	0,09
Options vendues		
Swaptions de défaillance sur indices de crédit	0,00	0,00
Swaptions de taux d'intérêt	(0,96)	(0,17)
Options sur titres	(0,01)	0,00
Swaps de défaillance sur émissions privées, souveraines et municipales américaines - vente de protection	0,01	0,01
Swaps de défaillance sur indices de crédit - vente de protection	0,01	0,01
Contrats de change à terme	(0,06)	(0,07)
Contrats de change à terme couverts	0,89	1,17
Titres vendus à découvert	(0,52)	(0,43)
Autres actifs et passifs à court terme	(2,77)	(1,67)
Actif net	100,00	100,00

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
VALEURS MOBILIÈRES				
AUSTRALIE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Driver Australia Six Trust				
3,910 % éch. 21/12/2027	AUD	953	$ 645	0,03
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Ausgrid Finance Pty. Ltd.				
3,750 % éch. 30/10/2024		4 690	3 115	0,13
3,850 % éch. 01/05/2023	$	7 800	7 761	0,33
4,306 % éch. 30/10/2024	AUD	6 100	4 125	0,18
ING Bank Australia Ltd.				
3,890 % éch. 26/05/2025		10 200	6 907	0,30
Pacific National Finance Pty. Ltd.				
6,000 % éch. 07/04/2023	$	3 200	3 199	0,14
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd.				
3,900 % éch. 22/03/2023		7 380	7 361	0,32
Toyota Finance Australia Ltd.				
3,558 % éch. 09/09/2024	AUD	2 000	1 344	0,06
3,796 % éch. 26/03/2024		1 000	675	0,03
Transurban Queensland Finance Pty. Ltd.				
5,238 % éch. 16/12/2024		1 570	1 079	0,05
Victoria Power Networks Finance Pty. Ltd.				
3,570 % éch. 23/08/2024		3 000	2 016	0,09
			37 582	1,63
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
FirstMac Mortgage Funding Trust				
5,021 % éch. 08/03/2049	$	73	73	0,00
Total Australie			38 300	1,66
BELGIQUE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Barry Callebaut Services NV				
5,500 % éch. 15/06/2023		9 119	9 076	0,39
BERMUDES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Aircastle Ltd.				
4,400 % éch. 25/09/2023		1 000	990	0,04
5,000 % éch. 01/04/2023		8 098	8 086	0,35
Total Bermudes			9 076	0,39
ÎLES CAÏMANS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Atlas Senior Loan Fund Ltd.				
5,113 % éch. 20/04/2028		172	171	0,01
Barings CLO Ltd.				
5,043 % éch. 20/01/2028		823	819	0,04
Catamaran CLO Ltd.				
5,425 % éch. 22/04/2030		895	883	0,04
CBAM CLO Ltd.				
5,099 % éch. 17/04/2031		3 050	2 996	0,13
Crestline Denali CLO Ltd.				
5,363 % éch. 20/01/2030		5 422	5 327	0,23
Dryden Senior Loan Fund				
4,979 % éch. 15/04/2029		540	536	0,02
Elevation CLO Ltd.				
5,355 % éch. 15/10/2029		6 722	6 681	0,29
Gallatin CLO Ltd.				
5,328 % éch. 21/01/2028		2 359	2 339	0,10
LCM LP				
5,283 % éch. 20/10/2027		2 413	2 402	0,10
Mountain View CLO Ltd.				
4,761 % éch. 13/10/2027		596	597	0,03
Nassau Ltd.				
5,229 % éch. 15/10/2029		1 141	1 127	0,05
OZLM Ltd.				
5,099 % éch. 15/04/2031		1 300	1 268	0,05
5,149 % éch. 17/01/2031		2 378	2 333	0,10
5,393 % éch. 20/01/2031		500	492	0,02
Sound Point CLO Ltd.				
5,344 % éch. 18/04/2031		4 600	4 501	0,19
Venture CLO Ltd.				
4,959 % éch. 15/04/2027	$	6 219	$ 6 210	0,27
4,959 % éch. 15/07/2027		270	270	0,01
5,343 % éch. 20/01/2029		5 508	5 444	0,24
5,596 % éch. 07/09/2030		1 600	1 571	0,07
			45 967	1,99
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Avolon Holdings Funding Ltd.				
2,875 % éch. 15/02/2025		2 500	2 311	0,10
5,125 % éch. 01/10/2023		3 300	3 264	0,14
5,500 % éch. 15/01/2023		2 700	2 693	0,12
Park Aerospace Holdings Ltd.				
4,500 % éch. 15/03/2023		4 000	3 991	0,17
QNB Finance Ltd.				
1,125 % éch. 17/06/2024		32 100	30 203	1,31
			42 462	1,84
Total îles Caïmans			88 429	3,83
DANEMARK				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Danske Bank A/S				
5,375 % éch. 12/01/2024		11 350	11 261	0,49
5,795 % éch. 12/09/2023		4 096	4 096	0,17
Total Danemark			15 357	0,66
FINLANDE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Nordea Bank Abp				
5,211 % éch. 06/06/2025		2 700	2 686	0,12
5,675 % éch. 30/08/2023		6 000	6 008	0,26
Total Finlande			8 694	0,38
FRANCE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BNP Paribas S.A.				
3,375 % éch. 09/01/2025		9 100	8 764	0,38
3,800 % éch. 10/01/2024		6 650	6 537	0,28
4,705 % éch. 10/01/2025		8 500	8 418	0,36
4,860 % éch. 28/02/2024	AUD	1 800	1 224	0,05
Crédit Agricole S.A.				
5,803 % éch. 22/03/2024	$	9 400	9 425	0,41
Société Générale S.A.				
2,625 % éch. 22/01/2025		11 600	10 914	0,47
3,875 % éch. 28/03/2024		2 500	2 443	0,11
4,250 % éch. 14/09/2023		2 700	2 677	0,12
4,934 % éch. 21/01/2026		8 975	8 667	0,38
Total France			59 069	2,56
ALLEMAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Deutsche Bank AG				
0,898 % éch. 28/05/2024 (e)		4 100	3 836	0,17
0,962 % éch. 08/11/2023		5 500	5 293	0,23
3,700 % éch. 30/05/2024		1 200	1 167	0,05
3,950 % éch. 27/02/2023		11 261	11 223	0,48
4,486 % éch. 30/01/2023	AUD	1 500	1 017	0,04
4,603 % éch. 08/11/2023	$	2 000	1 987	0,09
5,966 % éch. 27/02/2023		2 502	2 503	0,11
Total Allemagne			27 026	1,17
IRLANDE				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
Black Diamond CLO DAC				
2,778 % éch. 15/05/2032	€	5 500	5 691	0,25
4,793 % éch. 03/10/2029	$	95	95	0,00
BNPP AM Euro CLO DAC				
1,978 % éch. 15/04/2031	€	2 000	2 069	0,09
Cairn CLO DAC				
2,688 % éch. 20/10/2028		97	101	0,00
Carlyle Euro CLO DAC				
2,078 % éch. 15/01/2031		19 991	20 819	0,90
Contego CLO DAC				
2,142 % éch. 23/01/2030		13 475	14 017	0,61
Harvest CLO DAC				
2,433 % éch. 18/11/2029	€	225	$ 237	0,01
2,775 % éch. 26/06/2030		9 071	9 467	0,41
Oak Hill European Credit Partners DAC				
2,196 % éch. 20/10/2031		1 400	1 450	0,06
Palmer Square European Loan Funding DAC				
2,108 % éch. 15/07/2031		4 374	4 545	0,20
2,158 % éch. 15/04/2031		6 060	6 288	0,27
Tikehau CLO DAC				
2,596 % éch. 04/08/2034		15 000	15 541	0,67
Voya Euro CLO DAC				
2,128 % éch. 15/10/2030		11 022	11 515	0,50
			91 835	3,97
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
AerCap Ireland Capital DAC				
1,150 % éch. 29/10/2023	$	12 950	12 465	0,54
1,650 % éch. 29/10/2024		3 700	3 415	0,15
4,500 % éch. 15/09/2023		10 000	9 937	0,43
Perrigo Finance Unlimited Co.				
3,900 % éch. 15/12/2024		1 133	1 072	0,05
SMBC Aviation Capital Finance DAC				
3,550 % éch. 15/04/2024		3 700	3 579	0,15
4,125 % éch. 15/07/2023		3 200	3 167	0,14
			33 635	1,46
Total Irlande			125 470	5,43
ISRAËL				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Israel Electric Corp. Ltd.				
5,000 % éch. 12/11/2024		3 200	3 173	0,14
6,875 % éch. 21/06/2023		4 900	4 931	0,21
Total Israël			8 104	0,35
ITALIE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Eni SpA				
4,000 % éch. 12/09/2023		5 200	5 129	0,22
JAPON				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Aozora Bank Ltd.				
1,050 % éch. 09/09/2024		26 100	24 220	1,05
Chugoku Electric Power Co., Inc.				
2,401 % éch. 27/08/2024		1 500	1 427	0,06
Mitsubishi HC Capital, Inc.				
3,960 % éch. 19/09/2023		3 700	3 659	0,16
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.				
0,848 % éch. 15/09/2024		2 000	1 931	0,08
5,460 % éch. 18/07/2025		9 100	9 136	0,40
5,653 % éch. 12/09/2025		10 000	10 002	0,43
Mizuho Financial Group, Inc.				
3,922 % éch. 11/09/2024		5 500	5 413	0,24
4,899 % éch. 10/07/2024		4 000	3 991	0,17
5,345 % éch. 08/09/2024		9 200	9 142	0,40
Nissan Motor Co. Ltd.				
3,043 % éch. 15/09/2023		16 100	15 779	0,68
Nomura Holdings, Inc.				
1,851 % éch. 16/07/2025		16 800	15 328	0,66
2,329 % éch. 22/01/2027		4 400	3 858	0,17
2,648 % éch. 16/01/2025		3 500	3 307	0,14
Panasonic Holdings Corp.				
2,679 % éch. 19/07/2024		1 000	958	0,04
Renesas Electronics Corp.				
1,543 % éch. 26/11/2024		1 485	1 362	0,06
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.				
4,191 % éch. 16/10/2024	AUD	9 700	6 564	0,29
Total Japon			116 077	5,03
LUXEMBOURG				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
SES S.A.				
3,600 % éch. 04/04/2023	$	2 000	1 987	0,09

Tableau des investissements Fonds US Short-Term Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
CRÉDITS CONSORTIAUX ET CESSIONS				
Delos Finance SARL				
6,480 % éch. 06/10/2023	$	210	$ 210	0,01
Total Luxembourg			2 197	0,10
PAYS-BAS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
CNH Industrial NV				
4,500 % éch. 15/08/2023		4 612	4 584	0,20
Enel Finance International NV				
2,650 % éch. 10/09/2024		3 890	3 724	0,16
4,250 % éch. 15/06/2025		4 310	4 177	0,18
6,800 % éch. 14/10/2025		3 600	3 700	0,16
Iberdrola International BV				
5,810 % éch. 15/03/2025		1 100	1 116	0,05
ING Groep NV				
4,100 % éch. 02/10/2023		2 700	2 679	0,12
5,334 % éch. 01/04/2027		5 000	4 828	0,21
5,963 % éch. 28/03/2026		13 100	13 047	0,56
JDE Peet's NV				
0,800 % éch. 24/09/2024		9 955	9 099	0,39
LeasePlan Corp. NV				
2,875 % éch. 24/10/2024		3 100	2 911	0,13
Stellantis NV				
5,250 % éch. 15/04/2023		18 537	18 554	0,80
Vonovia Finance BV				
5,000 % éch. 02/10/2023		1 596	1 575	0,07
Total Pays-Bas			69 994	3,03
NORVÈGE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
DNB Bank ASA				
2,968 % éch. 28/03/2025		1 000	965	0,04
ARABIE SAOUDITE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Saudi Arabian Oil Co.				
1,250 % éch. 24/11/2023		600	578	0,02
1,625 % éch. 24/11/2025		2 200	2 010	0,09
Total Arabie saoudite			2 588	0,11
SINGAPOUR				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
BOC Aviation Ltd.				
5,849 % éch. 26/09/2023		1 700	1 698	0,07
CORÉE DU SUD				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Korea Southern Power Co. Ltd.				
4,056 % éch. 30/10/2024	AUD	5 300	3 586	0,16
SK Broadband Co. Ltd.				
3,875 % éch. 13/08/2023	$	1 500	1 488	0,06
SK Hynix, Inc.				
1,000 % éch. 19/01/2024		8 704	8 272	0,36
SK Telecom Co. Ltd.				
3,750 % éch. 16/04/2023		3 305	3 292	0,14
Woori Bank				
5,310 % éch. 01/02/2023		1 200	1 200	0,05
			17 838	0,77
ÉMISSIONS SOUVERAINES				
Export-Import Bank of Korea				
5,558 % éch. 27/04/2023		1 029	1 032	0,05
Banque de développement coréenne				
0,500 % éch. 27/10/2023		500	483	0,02
			1 515	0,07
Total Corée du Sud			19 353	0,84
ESPAGNE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A.				
0,875 % éch. 18/09/2023		6 800	6 587	0,28
Banco Santander S.A.				
3,848 % éch. 12/04/2023	$	2 400	$ 2 387	0,10
4,612 % éch. 19/01/2023	AUD	1 200	814	0,04
Total Espagne			9 788	0,42
SUPRANATIONALES				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Banque internationale pour la reconstruction et le développement				
0,650 % éch. 10/02/2026	$	10 000	8 950	0,39
0,850 % éch. 10/02/2027		18 800	16 382	0,71
Total Supranationales			25 332	1,10
SUISSE				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Credit Suisse AG				
4,260 % éch. 26/05/2023	AUD	3 900	2 626	0,11
4,441 % éch. 02/02/2024	$	2 000	1 914	0,08
Credit Suisse Group AG				
2,193 % éch. 05/06/2026		2 500	2 137	0,09
3,800 % éch. 09/06/2023		4 100	3 993	0,17
4,207 % éch. 12/06/2024		600	585	0,03
4,372 % éch. 08/03/2024	AUD	1 000	668	0,03
5,975 % éch. 12/06/2024	$	1 000	947	0,04
UBS AG				
3,956 % éch. 30/07/2025	AUD	7 225	4 891	0,21
UBS Group AG				
5,706 % éch. 12/05/2026	$	15 000	15 123	0,66
Total Suisse			32 884	1,42
ÉMIRATS ARABES UNIS				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
First Abu Dhabi Bank PJSC				
1,375 % éch. 19/02/2023	£	900	1 077	0,05
4,145 % éch. 18/02/2025	AUD	1 040	700	0,03
Total Émirats arabes unis			1 777	0,08
ROYAUME-UNI				
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
Barclays PLC				
3,650 % éch. 16/03/2025	$	2 500	2 404	0,10
5,396 % éch. 26/06/2024	AUD	2 750	1 877	0,08
6,024 % éch. 16/05/2024	$	17 950	17 951	0,78
British Telecommunications PLC				
4,500 % éch. 04/12/2023		1 175	1 165	0,05
HSBC Holdings PLC				
4,150 % éch. 16/02/2024	AUD	6 000	4 065	0,18
5,696 % éch. 10/03/2026	$	3 500	3 457	0,15
5,965 % éch. 11/03/2025		15 500	15 370	0,66
6,115 % éch. 12/09/2026		2 820	2 777	0,12
Imperial Brands Finance PLC				
3,125 % éch. 26/07/2024		11 300	10 809	0,47
Lloyds Banking Group PLC				
4,507 % éch. 20/03/2023	AUD	3 300	2 238	0,10
4,518 % éch. 07/03/2025		2 360	1 581	0,07
Nationwide Building Society				
3,766 % éch. 08/03/2024	$	2 500	2 486	0,11
4,363 % éch. 01/08/2024		3 635	3 588	0,16
NatWest Markets PLC				
5,773 % éch. 22/03/2025		8 900	8 824	0,38
Santander UK Group Holdings PLC				
1,089 % éch. 15/03/2025		16 700	15 611	0,68
3,373 % éch. 05/01/2024		1 000	1 000	0,04
4,796 % éch. 15/11/2024		1 000	984	0,04
Standard Chartered PLC				
5,123 % éch. 23/11/2025		9 100	8 845	0,38
6,063 % éch. 30/03/2026		12 000	11 809	0,51
			116 841	5,06
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
Avon Finance PLC				
4,331 % éch. 20/09/2048	£	10 756	12 694	0,55
Canada Square Funding PLC				
4,205 % éch. 17/06/2058		6 388	7 396	0,32
Eurohome UK Mortgages PLC				
3,946 % éch. 15/06/2044		343	393	0,02
Finsbury Square PLC				
4,419 % éch. 16/12/2069	£	3 618	$ 4 351	0,19
Great Hall Mortgages PLC				
3,695 % éch. 18/06/2038		28	33	0,00
Precise Mortgage Funding PLC				
4,186 % éch. 12/03/2055		512	615	0,03
4,265 % éch. 16/10/2056		1 840	2 183	0,09
Residential Mortgage Securities PLC				
4,681 % éch. 20/06/2070		132	158	0,01
RMAC PLC				
4,206 % éch. 12/06/2046		786	941	0,04
4,476 % éch. 12/06/2046		2 856	3 422	0,15
Stratton Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2060		16 883	20 136	0,87
4,287 % éch. 12/03/2052		4 427	5 304	0,23
4,292 % éch. 25/09/2051		5 991	7 114	0,31
Towd Point Mortgage Funding PLC				
3,826 % éch. 20/07/2045		5 172	6 155	0,26
4,071 % éch. 20/10/2051		755	903	0,04
Tudor Rose Mortgages				
4,031 % éch. 20/06/2048		4 874	5 782	0,25
			77 580	3,36
Total Royaume-Uni			194 421	8,42
ÉTATS-UNIS				
TITRES ADOSSÉS À DES ACTIFS				
American Tower Trust				
3,070 % éch. 15/03/2048	$	2 000	1 989	0,09
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust				
5,046 % éch. 25/03/2034		20	21	0,00
5,514 % éch. 25/03/2035		391	385	0,02
CIT Mortgage Loan Trust				
5,739 % éch. 25/10/2037		1 588	1 580	0,07
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust				
4,944 % éch. 25/06/2036		151	150	0,01
5,889 % éch. 25/10/2034		781	772	0,03
EFS Volunteer LLC				
5,208 % éch. 25/10/2035		178	177	0,01
EquiFirst Mortgage Loan Trust				
7,389 % éch. 25/10/2034		582	549	0,02
Finance America Mortgage Loan Trust				
5,214 % éch. 25/08/2034		798	738	0,03
First NLC Trust				
4,459 % éch. 25/08/2037		236	112	0,00
Fremont Home Loan Trust				
5,124 % éch. 25/01/2035		284	274	0,01
Home Equity Asset Trust				
5,334 % éch. 25/06/2034		645	628	0,03
Long Beach Mortgage Loan Trust				
5,364 % éch. 25/04/2035		1 224	1 207	0,05
MASTR Asset-Backed Securities Trust				
5,089 % éch. 25/09/2034		910	774	0,03
Morgan Stanley ABS Capital, Inc. Trust				
5,439 % éch. 25/09/2033		664	655	0,03
Navient Private Education Loan Trust				
2,650 % éch. 15/12/2028		570	564	0,02
5,768 % éch. 16/07/2040		3 022	2 981	0,13
5,918 % éch. 15/10/2031		7 200	7 128	0,31
Nelnet Student Loan Trust				
4,989 % éch. 27/02/2051		1 142	1 129	0,05
NovaStar Mortgage Funding Trust				
5,049 % éch. 25/01/2036		954	936	0,04
RAAC Trust				
6,489 % éch. 25/05/2044		1 336	1 276	0,06
SBA Tower Trust				
3,869 % éch. 15/10/2049		3 000	2 869	0,12
SLC Student Loan Trust				
4,666 % éch. 15/05/2029		1 208	1 168	0,05
SLM Private Credit Student Loan Trust				
5,099 % éch. 15/06/2039		4 844	4 598	0,20
SLM Student Loan Trust				
4,958 % éch. 25/10/2029		1 839	1 823	0,08
5,039 % éch. 27/12/2038		1 170	1 122	0,05
5,258 % éch. 25/07/2023		809	801	0,03
5,858 % éch. 25/04/2023		820	815	0,04

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
6,058 % éch. 25/07/2023	$	189	$ 187	0,01
SMB Private Education Loan Trust				
1,600 % éch. 15/09/2054		2 926	2 601	0,11
5,068 % éch. 15/10/2035		1 419	1 402	0,06
5,768 % éch. 17/02/2032		107	106	0,00
Structured Asset Investment Loan Trust				
4,939 % éch. 25/09/2034		1 706	1 573	0,07
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust				
6,114 % éch. 25/11/2035		1 775	1 739	0,08
			44 829	1,94
OBLIGATIONS ET BILLETS PRIVÉS				
7-Eleven, Inc.				
0,625 % éch. 10/02/2023		5 900	5 870	0,25
0,800 % éch. 10/02/2024		5 500	5 236	0,23
Air Lease Corp.				
2,250 % éch. 15/01/2023		4 600	4 596	0,20
2,750 % éch. 15/01/2023		1 500	1 498	0,07
Ally Financial, Inc.				
3,050 % éch. 05/06/2023		6 100	6 032	0,26
American Tower Corp.				
3,000 % éch. 15/06/2023		5 791	5 730	0,25
3,500 % éch. 31/01/2023		3 723	3 719	0,16
5,000 % éch. 15/02/2024		1 000	997	0,04
AT&T, Inc.				
5,540 % éch. 15/02/2023		7 700	7 702	0,33
Athene Global Funding				
1,200 % éch. 13/10/2023		1 120	1 083	0,05
4,556 % éch. 08/01/2024		1 900	1 884	0,08
Bank of America Corp.				
1,486 % éch. 19/05/2024		1 000	984	0,04
3,550 % éch. 05/03/2024		1 100	1 096	0,05
4,684 % éch. 24/10/2024		7 500	7 433	0,32
5,653 % éch. 02/04/2026		5 900	5 854	0,25
BAT Capital Corp.				
2,789 % éch. 06/09/2024		2 900	2 777	0,12
3,222 % éch. 15/08/2024		14 750	14 212	0,62
Baxter International, Inc.				
4,495 % éch. 01/12/2023		4 533	4 499	0,19
Bayer U.S. Finance LLC				
3,875 % éch. 15/12/2023		7 500	7 394	0,32
5,779 % éch. 15/12/2023		9 100	9 082	0,39
Berry Global, Inc.				
0,950 % éch. 15/02/2024		6 000	5 687	0,25
4,875 % éch. 15/07/2026		7 450	7 190	0,31
BGC Partners, Inc.				
5,375 % éch. 24/07/2023		5 044	5 021	0,22
Boeing Co.				
1,875 % éch. 15/06/2023		3 300	3 250	0,14
4,508 % éch. 01/05/2023		27 500	27 453	1,19
Cantor Fitzgerald LP				
4,875 % éch. 01/05/2024		5 550	5 448	0,24
Capital One Financial Corp.				
5,476 % éch. 09/05/2025		2 000	1 976	0,09
CenterPoint Energy Resources Corp.				
5,279 % éch. 02/03/2023		4 198	4 196	0,18
Charter Communications Operating LLC				
4,908 % éch. 23/07/2025		1 000	981	0,04
6,090 % éch. 01/02/2024		31 210	31 359	1,35
Citigroup, Inc.				
4,775 % éch. 27/10/2023	AUD	1 631	1 112	0,05
5,750 % éch. 17/05/2024	$	12 733	12 754	0,55
5,784 % éch. 01/06/2024		5 500	5 508	0,24
5,850 % éch. 17/03/2026 (e)		3 400	3 410	0,15
CNH Industrial Capital LLC				
1,950 % éch. 02/07/2023		7 007	6 889	0,30
CNO Global Funding				
1,650 % éch. 06/01/2025		900	834	0,04
DAE Funding LLC				
1,550 % éch. 01/08/2024		5 600	5 207	0,23
Daimler Trucks Finance North America LLC				
1,125 % éch. 14/12/2023		4 700	4 517	0,20
5,062 % éch. 13/12/2024		4 300	4 243	0,18
Dell International LLC				
5,450 % éch. 15/06/2023		14 379	14 390	0,62
Dominion Energy, Inc.				
5,299 % éch. 15/09/2023		500	499	0,02
Five Corners Funding Trust				
4,419 % éch. 15/11/2023	$	800	$ 793	0,03
Ford Motor Credit Co. LLC				
3,370 % éch. 17/11/2023		1 000	977	0,04
FS KKR Capital Corp.				
1,650 % éch. 12/10/2024		2 000	1 807	0,08
GA Global Funding Trust				
0,800 % éch. 13/09/2024		300	274	0,01
1,250 % éch. 08/12/2023		1 500	1 440	0,06
1,625 % éch. 15/01/2026		3 500	3 111	0,13
5,085 % éch. 11/04/2025		3 000	2 934	0,13
General Motors Financial Co., Inc.				
1,700 % éch. 18/08/2023		10 000	9 773	0,42
4,150 % éch. 19/06/2023		5 000	4 974	0,22
4,250 % éch. 15/05/2023		500	498	0,02
5,100 % éch. 17/01/2024		8 670	8 639	0,37
5,360 % éch. 17/11/2023		8 000	7 979	0,35
Goldman Sachs Group, Inc.				
0,925 % éch. 21/10/2024		6 700	6 421	0,28
4,605 % éch. 02/05/2024	AUD	3 000	2 041	0,09
5,069 % éch. 09/12/2026	$	4 300	4 142	0,18
5,442 % éch. 23/02/2023		1 600	1 601	0,07
GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC				
3,024 % éch. 24/03/2024		3 500	3 399	0,15
Harley-Davidson Financial Services, Inc.				
3,350 % éch. 15/02/2023		1 500	1 497	0,06
HCA, Inc.				
5,000 % éch. 15/03/2024		10 235	10 181	0,44
Hyatt Hotels Corp.				
1,300 % éch. 01/10/2023		9 400	9 140	0,40
Hyundai Capital America				
0,800 % éch. 08/01/2024		2 365	2 251	0,10
0,875 % éch. 14/06/2024		1 800	1 680	0,07
5,750 % éch. 06/04/2023		4 000	4 003	0,17
Infor, Inc.				
1,450 % éch. 15/07/2023		1 000	977	0,04
Jackson National Life Global Funding				
5,473 % éch. 28/06/2024		8 200	8 203	0,36
JPMorgan Chase & Co.				
3,559 % éch. 23/04/2024		2 500	2 484	0,11
5,215 % éch. 23/07/2024		2 800	2 805	0,12
5,274 % éch. 26/04/2026		4 215	4 178	0,18
Kansas City Southern				
3,000 % éch. 15/05/2023		2 000	1 983	0,09
Kinder Morgan, Inc.				
5,625 % éch. 15/11/2023		2 000	2 002	0,09
Leidos, Inc.				
2,950 % éch. 15/05/2023		9 505	9 430	0,41
Marvell Technology, Inc.				
4,200 % éch. 22/06/2023		1 087	1 081	0,05
Mercedes-Benz Finance North America LLC				
5,348 % éch. 04/05/2023		2 000	2 000	0,09
5,500 % éch. 27/11/2024		3 200	3 220	0,14
Microchip Technology, Inc.				
0,983 % éch. 01/09/2024		5 000	4 633	0,20
4,333 % éch. 01/06/2023		1 000	996	0,04
Morgan Stanley				
3,737 % éch. 24/04/2024		800	796	0,03
5,770 % éch. 08/05/2024		700	701	0,03
Mylan, Inc.				
4,200 % éch. 29/11/2023		1 000	990	0,04
Navient Corp.				
5,500 % éch. 25/01/2023		4 200	4 200	0,18
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.				
5,342 % éch. 21/03/2024		17 700	17 605	0,76
Nissan Motor Acceptance Co. LLC				
3,875 % éch. 21/09/2023		1 000	982	0,04
OGE Energy Corp.				
0,703 % éch. 26/05/2023		4 400	4 323	0,19
Pacific Gas & Electric Co.				
1,700 % éch. 15/11/2023		5 700	5 518	0,24
3,250 % éch. 15/06/2023 ^		1 700	1 681	0,07
3,400 % éch. 15/08/2024 ^		500	480	0,02
3,750 % éch. 15/02/2024 ^		1 700	1 666	0,07
3,850 % éch. 15/11/2023 ^		300	296	0,01
4,250 % éch. 01/08/2023		2 000	1 990	0,09
Piper Sandler Cos.				
5,200 % éch. 15/10/2023	$	3 500	$ 3 469	0,15
RELX Capital, Inc.				
3,500 % éch. 16/03/2023		10 200	10 160	0,44
Sabine Pass Liquefaction LLC				
5,750 % éch. 15/05/2024		1 500	1 501	0,07
Southern California Edison Co.				
5,153 % éch. 01/04/2024		4 500	4 469	0,19
Synchrony Financial				
4,375 % éch. 19/03/2024		4 900	4 814	0,21
TD SYNNEX Corp.				
1,250 % éch. 09/08/2024		8 000	7 435	0,32
Thermo Fisher Scientific, Inc.				
4,340 % éch. 18/10/2024		11 500	11 395	0,49
Verizon Communications, Inc.				
5,706 % éch. 15/05/2025		8 221	8 290	0,36
VMware, Inc.				
0,600 % éch. 15/08/2023		500	487	0,02
1,000 % éch. 15/08/2024		2 500	2 328	0,10
Volkswagen Group of America Finance LLC				
3,125 % éch. 12/05/2023		580	576	0,02
3,950 % éch. 06/06/2025		15 700	15 207	0,66
Warnermedia Holdings, Inc.				
3,428 % éch. 15/03/2024		2 200	2 137	0,09
3,788 % éch. 15/03/2025		3 000	2 868	0,12
6,092 % éch. 15/03/2024		3 400	3 390	0,15
Wells Fargo & Co.				
5,241 % éch. 25/04/2026		16 500	16 456	0,71
			519 359	22,47
OBLIGATIONS ET BILLETS MUNICIPAUX				
Obligations Pennsylvania Higher Education Assistance Agency Revenue Bonds, (GTD STD LNS Insured), Series 2006				
4,488 % éch. 25/10/2036		703	693	0,03
TITRES ADOSSÉS À DES CRÉANCES HYPOTHÉCAIRES NON ÉMIS PAR DES ORGANISMES GOUVERNEMENTAUX				
American Home Mortgage Investment Trust				
4,989 % éch. 25/09/2045		1 707	1 484	0,06
Ashford Hospitality Trust				
5,218 % éch. 15/04/2035		1 213	1 173	0,05
Atrium Hotel Portfolio Trust				
5,268 % éch. 15/06/2035		11 300	10 919	0,47
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust				
5,318 % éch. 15/07/2037		900	876	0,04
Bear Stearns Adjustable Rate Mortgage Trust				
3,953 % éch. 25/02/2036 ^		2	2	0,00
Bear Stearns ALT-A Trust				
3,729 % éch. 25/09/2035 ^		13	8	0,00
BX Trust				
5,118 % éch. 15/05/2035		2 775	2 708	0,12
Citigroup Commercial Mortgage Trust				
3,251 % éch. 10/05/2035		1 065	999	0,04
Commercial Mortgage Trust				
3,178 % éch. 10/02/2035		3 000	2 776	0,12
Credit Suisse Mortgage Capital Trust				
2,688 % éch. 25/03/2059		3 668	3 483	0,15
5,068 % éch. 15/07/2032		2 000	1 886	0,08
DBCG Mortgage Trust				
5,018 % éch. 15/06/2034		21 800	21 432	0,93
DBGS Mortgage Trust				
5,113 % éch. 15/06/2033		2 600	2 486	0,11
DBWF Mortgage Trust				
5,469 % éch. 19/12/2030		5 100	4 956	0,22
Deutsche Mortgage Securities, Inc. Re-REMIC Trust Certificates				
3,792 % éch. 28/09/2036		1 120	1 112	0,05
GS Mortgage Securities Trust				
3,648 % éch. 10/01/2047		243	241	0,01
GSR Mortgage Loan Trust				
3,028 % éch. 25/06/2034		51	49	0,00
3,954 % éch. 25/11/2035 ^		110	90	0,00
Impac CMB Trust				
5,029 % éch. 25/03/2035		87	79	0,00
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust				
4,128 % éch. 05/07/2031		4 500	4 222	0,18
5,528 % éch. 15/06/2035		2 229	2 038	0,09

Tableau des investissements Fonds US Short-Term Fund (suite)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	JUSTE VALEUR (en milliers)	EN % DE L'ACTIF NET
Merrill Lynch Mortgage Investors Trust				
3,011 % éch. 25/05/2033	$	194	$ 185	0,01
6,709 % éch. 25/03/2033		258	238	0,01
Mill City Mortgage Loan Trust				
2,750 % éch. 25/07/2059		389	383	0,02
New Residential Mortgage Loan Trust				
3,500 % éch. 25/12/2057		412	391	0,02
4,500 % éch. 25/05/2058		197	185	0,01
Sequoia Mortgage Trust				
5,033 % éch. 20/10/2034		513	456	0,02
Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust				
3,887 % éch. 25/03/2034		10	9	0,00
Structured Asset Mortgage Investments Trust				
4,999 % éch. 19/10/2034		321	300	0,01
Towd Point Mortgage Trust				
3,750 % éch. 25/05/2058		8 993	8 518	0,37
WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Trust				
3,813 % éch. 25/10/2035		251	229	0,01
4,849 % éch. 25/04/2045		1	1	0,00
4,929 % éch. 25/12/2045		32	29	0,00
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust				
4,218 % éch. 15/07/2046		800	793	0,03
Wells Fargo-RBS Commercial Mortgage Trust				
3,337 % éch. 15/06/2046		14 400	14 241	0,62
			88 977	3,85
AGENCES DU GOUVERNEMENT AMÉRICAIN				
Fannie Mae				
2,000 % éch. 25/08/2038		5 775	5 233	0,23
3,145 % éch. 25/08/2050		1 823	1 709	0,07
3,546 % éch. 25/11/2047		2 997	2 895	0,13
3,830 % éch. 01/10/2037		96	98	0,00
4,639 % éch. 25/01/2037		37	36	0,00
4,699 % éch. 25/04/2037		3	3	0,00
4,719 % éch. 25/04/2037		7	7	0,00
4,739 % éch. 25/07/2037		40	39	0,00
4,759 % éch. 25/05/2037		30	29	0,00
4,779 % éch. 25/04/2037		367	359	0,02
4,789 % éch. 25/05/2037 - 25/10/2040		34	33	0,00
4,809 % éch. 25/05/2037		50	49	0,00
4,839 % éch. 25/10/2030 - 25/06/2060		19 240	18 618	0,81
4,889 % éch. 25/08/2037		50	49	0,00
4,939 % éch. 25/12/2049		10	10	0,00
5,059 % éch. 25/03/2038		59	58	0,00
5,069 % éch. 25/12/2037		43	42	0,00
5,089 % éch. 25/01/2041		68	67	0,00
5,389 % éch. 25/05/2037		197	200	0,01
Federal Home Loan Bank				
0,900 % éch. 26/02/2027		26 500	22 943	0,99
1,115 % éch. 26/02/2027		31 500	27 524	1,19
5,400 % éch. 21/11/2024		35 000	35 017	1,52
Freddie Mac				
0,000 % éch. 15/01/2038 (a)		699	26	0,00
2,500 % éch. 25/10/2048		789	703	0,03
3,000 % éch. 25/09/2045		2 211	2 049	0,09
3,258 % éch. 15/10/2040		7 520	7 322	0,32
3,358 % éch. 15/01/2038		17 507	17 520	0,76
3,448 % éch. 25/07/2044		4	4	0,00
3,729 % éch. 15/08/2038		261	262	0,01
4,000 % éch. 01/08/2048		1 527	1 459	0,06
4,618 % éch. 15/05/2037		48	47	0,00
4,718 % éch. 15/02/2034 - 15/08/2056		7 249	6 939	0,30
4,728 % éch. 15/06/2037		560	549	0,02
4,768 % éch. 15/10/2036 - 15/06/2042		46	46	0,00
4,789 % éch. 25/07/2050		9 795	9 461	0,41
4,798 % éch. 15/10/2040		73	72	0,00
4,818 % éch. 15/11/2050		78	76	0,00
4,838 % éch. 15/05/2036 - 15/12/2041		173	169	0,01
5,400 % éch. 23/12/2024		20 000	19 999	0,87
Ginnie Mae				
0,706 % éch. 20/12/2068		1 054	1 021	0,04
1,750 % éch. 20/11/2029		2	2	0,00
1,968 % éch. 20/04/2067		3 514	3 476	0,15
2,500 % éch. 20/01/2049 - 20/06/2051		14 536	12 182	0,53
2,625 % éch. 20/08/2024 - 20/03/2030		26	27	0,00
2,863 % éch. 20/01/2066		436	429	0,02
3,000 % éch. 20/06/2051 - 20/07/2051		50 093	43 147	1,87
3,896 % éch. 20/12/2065		871	856	0,04
4,302 % éch. 20/02/2067		747	741	0,03
4,398 % éch. 20/09/2066		1 470	1 501	0,07
4,592 % éch. 20/08/2067		2 028	2 009	0,09
4,692 % éch. 20/11/2066		814	805	0,04
4,853 % éch. 20/10/2037		148	148	0,01
5,232 % éch. 20/05/2071		5 438	5 590	0,24
5,238 % éch. 20/06/2071	$	5 748	$ 5 898	0,26
5,326 % éch. 20/06/2071		7 051	7 219	0,31
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS)				
4,000 % éch. 01/09/2049		3 803	3 613	0,16
			270 385	11,71
OBLIGATIONS DU TRÉSOR AMÉRICAIN				
Billets du Trésor américain				
3,500 % éch. 15/09/2025		63 700	62 436	2,70
Total États-Unis			986 679	42,70
INSTRUMENTS À COURT TERME				
BILLETS DE TRÉSORERIE				
Walgreens Boots Alliance, Inc.				
4,900 % éch. 11/01/2023		4 500	4 493	0,19
BILLETS À COURT TERME				
Federal Home Loan Bank				
4,320 % éch. 06/01/2023		26 100	26 100	1,13
BONS DU TRÉSOR ISRAÉLIEN				
1,184 % éch. 02/03/2023 (b)(c)	ILS	12 900	3 635	0,16
Total des Instruments à court terme			34 228	1,48
Total des Valeurs mobilières			**$ 1 891 711**	**81,88**
			ACTIONS	
FONDS D'INVESTISSEMENT				
ORGANISMES DE PLACEMENT COLLECTIF				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (d)		6 194	62	0,00
FONDS NÉGOCIÉS EN BOURSE				
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (d)		2 280 887	225 956	9,78
Total des Fonds d'investissement			**$ 226 018**	**9,78**

CONTRATS DE MISE EN PENSION

Contrepartie	Taux prêteur	Date de règlement	Date d'échéance	Montant du principal	Garanti par	Garantie (reçue)	Contrats de mise en pension, à la valeur	Produits des contrats de mise en pension à recevoir[1]	En % de l'actif net
FICC	1,900 %	30/12/2022	03/01/2023	$ 2 672	Bons du Trésor américain 0,000 % éch. 08/06/2023	$ (2 725)	$ 2 672	$ 2 672	0,12
	4,280	30/12/2022	03/01/2023	151 800	Billets du Trésor américain 0,250 % éch. 31/10/2025	(154 836)	151 800	151 872	6,57
Total des Contrats de mise en pension						**$ (157 561)**	**$ 154 472**	**$ 154 544**	**6,69**

[1] Comprend les intérêts courus.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS NÉGOCIÉS SUR UN MARCHÉ RÉGLEMENTÉ (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS À TERME STANDARDISÉS

Description	Type	Mois d'expiration	Nbre de Contrats	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Long	09/2023	2 250	$ (74)	0,00
Contrats à terme standardisés sur SOFR à 3 mois juin	Court	09/2024	854	479	0,02
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 2 ans mars	Court	03/2023	2 026	71	0,00
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 5 ans mars	Court	03/2023	2 401	394	0,02
Contrats à terme standardisés sur billet du Trésor américain à 10 ans mars	Court	03/2023	61	18	0,00
Contrats à terme standardisés sur obligation du Trésor américain à ultra long terme mars	Court	03/2023	176	55	0,00
				$ 943	0,04
Total des Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé				**$ 943**	**0,04**

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS COMPENSÉS (montants en milliers*)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

SWAPS DE DÉFAILLANCE SUR INDICES DE CRÉDIT - ACHAT DE PROTECTION[1]

Indices/Tranches	Taux fixe (à payer)	Date d'échéance	Montant notionnel[2]	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
Indice CDX.IG-37 à 5 ans	(1,000) %	20/12/2026	$ 65 700	$ 771	0,04
Indice CDX.IG-39 à 5 ans	(1,000)	20/12/2027	444 300	(694)	(0,03)
				$ 77	0,01

SWAPS DE TAUX D'INTÉRÊT - SWAPS DE BASE

Indice de taux variable à payer	Indice de taux variable à recevoir	Date d'échéance	Montant notionnel	Plus-value/ (moins-value) latente	En % de l'actif net
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,098 %	13/01/2023	$ 39 800	$ 23	0,00
LIBOR USD à 3 mois	LIBOR USD à 1 mois + 0,098 %	13/01/2023	52 000	29	0,00
				$ 52	0,00
Total des Instruments financiers dérivés compensés				**$ 129**	**0,01**

(1) Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités, titres ou autres obligations livrables équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé.

(2) Le montant potentiel maximum que le Fonds pourrait être tenu de payer ou recevoir respectivement en tant que vendeur ou acheteur de protection de crédit si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné.

INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS HORS COTE (montants en milliers*, sauf le nombre de contrats)

*** Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.**

CONTRATS DE CHANGE À TERME

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
AZD	01/2023	$ 13 226	¥ 1 950 000	$ 1 566	$ 0	$ 1 566	0,07
BOA	01/2023	¥ 3 740 000	$ 26 156	0	(2 213)	(2 213)	(0,10)
	02/2023	$ 6 387	AUD 9 382	7	(21)	(14)	0,00
BPS	03/2023	ILS 12 700	$ 3 741	131	0	131	0,01
BRC	01/2023	$ 2 332	£ 1 922	0	(19)	(19)	0,00
CBK	02/2023	AUD 94 089	$ 62 987	0	(930)	(930)	(0,04)
DUB	03/2023	MXN 13 925	701	0	(4)	(4)	0,00
JPM	01/2023	£ 72 058	87 012	320	0	320	0,01
	02/2023	$ 702	MXN 14 389	30	0	30	0,00
MBC	01/2023	€ 86 187	$ 90 330	0	(1 693)	(1 693)	(0,07)
	02/2023	$ 2 028	AUD 3 014	19	0	19	0,00
MYI	01/2023	€ 2 359	$ 2 506	0	(11)	(11)	0,00
	01/2023	$ 7	€ 6	0	0	0	0,00
RBC	03/2023	MXN 58	$ 3	0	0	0	0,00
SCX	01/2023	$ 1 404	£ 1 134	0	(40)	(40)	0,00
	01/2023	13 060	¥ 1 790 263	519	0	519	0,02
UAG	01/2023	3 566	£ 2 880	0	(101)	(101)	(0,01)
				$ 2 592	$ (5 032)	$ (2 440)	(0,11)

CONTRATS DE CHANGE À TERME COUVERTS

Au 31 décembre 2022, les contrats de change à terme suivants étaient en cours au titre des Catégories Institutions en EUR (couverte) de capitalisation et E en EUR (couverte) de capitalisation :

Contrepartie	Mois de règlement	Devise à livrer	Devise à recevoir	Plus-value latente	(Moins-value) latente	Plus-value/ (moins-value) latente nette	En % de l'actif net
BOA	01/2023	€ 45	$ 49	$ 0	$ 0	$ 0	0,00
	01/2023	$ 6 481	€ 6 133	68	0	68	0,00
BRC	01/2023	344	325	2	0	2	0,00
CBK	01/2023	€ 5 912	$ 6 288	0	(24)	(24)	0,00
	01/2023	$ 87 518	€ 84 254	2 441	0	2 441	0,11
MBC	01/2023	€ 6	$ 7	0	0	0	0,00
	01/2023	$ 81 212	€ 77 487	1 521	0	1 521	0,07
MYI	01/2023	2 391	2 247	9	0	9	0,00
SCX	01/2023	85 361	81 925	2 111	0	2 111	0,09
				$ 6 152	$ (24)	$ 6 128	0,27
Total des Instruments financiers dérivés hors cote						**$ 3 688**	**0,16**
Total des Investissements						**$ 2 276 961**	**98,56**
Autres actifs et passifs à court terme						**$ 33 154**	**1,44**
Actif net						**$ 2 310 115**	**100,00**

NOTES RELATIVES AU TABLEAU DES INVESTISSEMENTS (montants en milliers*) :

* Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis.

^ Un défaut de paiement est constaté sur ce titre.

(a) Le titre est à intérêts uniquement (« IO ») ou un titre représentatif des seuls intérêts (IO Strip).

(b) Titre à coupon zéro.

(c) Le coupon représente un rendement jusqu'à l'échéance.

(d) Affilié au Fonds.

(e) Titres sujets à restrictions (31 décembre 2021 : 0,10 %) :

Description de l'émetteur	Coupon	Date d'échéance	Date d'achat	Coût	Juste valeur	En % de l'actif net
Citigroup, Inc.	5,850 %	17/03/2026	10/03/2022	$ 3 400	$ 3 410	0,15
Deutsche Bank AG	0,898	28/05/2024	25/05/2021 - 31/03/2022	4 056	3 836	0,17
				$ 7 456	$ 7 246	0,32

Un titre d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 215 008 $) a été nanti en garantie en vertu des Contrats cadres de mise en pension et/ou des Contrats cadres globaux de mise en pension au 31 décembre 2022.

Un titre d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 237 156 $) a été nanti ou livré en garantie de titres à livraison différée ou d'opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos, en vertu des Contrats cadres de transaction à terme au 31 décembre 2022.

Un montant en numéraire de 16 350 $ (31 décembre 2021 : 15 635 $) a été nanti en garantie d'instruments financiers dérivés compensés et négociés en bourse au 31 décembre 2022.

Un titre d'une juste valeur globale de 0 $ (31 décembre 2021 : 281 $) et un montant en numéraire de 1 780 $ (31 décembre 2021 : 3 950 $) ont été nantis en garantie d'instruments financiers dérivés au 31 décembre 2022 ainsi que le prescrivent les contrats cadres de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc.

Évaluations de la juste valeur[1]

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2022 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 1 891 711	$ 0	$ 1 891 711
Fonds d'investissement	62	225 956	0	226 018
Contrats de mise en pension	0	154 472	0	154 472
Instruments financiers dérivés[3]	0	4 760	0	4 760
Totaux	**$ 62**	**$ 2 276 899**	**$ 0**	**$ 2 276 961**

Voici une synthèse des justes valeurs, d'après les données utilisées pour évaluer les actifs et passifs du Fonds au 31 décembre 2021 :

Catégorie[2]	Cours cotés sur des marchés actifs pour des investissements identiques (Niveau 1)	Autres données significatives observables (Niveau 2)	Données significatives non observables (Niveau 3)	Juste valeur
Valeurs mobilières	$ 0	$ 2 807 383	$ 0	$ 2 807 383
Fonds d'investissement	269 578	0	0	269 578
Contrats de mise en pension	0	1 571	0	1 571
Instruments financiers dérivés[3]	(7 684)	(3 708)	0	(11 392)
Totaux	**$ 261 894**	**$ 2 805 246**	**$ 0**	**$ 3 067 140**

(1) Pour de plus amples informations, voir la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

(2) Veuillez vous reporter au Tableau des investissements pour des informations supplémentaires.

(3) Les instruments financiers dérivés peuvent comprendre des contrats à terme standardisés ouverts, des contrats de swap, des options vendues, des options achetées et des contrats de change à terme.

Garantie (reçue)/nantie pour les instruments financiers dérivés hors cote

Voici une synthèse par contrepartie de la juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote et de la garantie (reçue)/nantie au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 :

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
Contrepartie	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
AZD	$ 1 566	$ (1 460)	$ 106	$ S/O	$ S/O	$ S/O
BOA	(2 159)	1 770	(389)	(145)	0	(145)
BPS	131	0	131	(135)	0	(135)
BRC	(17)	0	(17)	133	0	133
CBK	1 487	(1 350)	137	(244)	281	37
DUB	(4)	0	(4)	(25)	0	(25)
GLM	S/O	S/O	S/O	(719)	770	51
GSC	S/O	S/O	S/O	(3)	0	(3)
HUS	S/O	S/O	S/O	172	0	172
JPM	350	(290)	60	892	(780)	112
MBC	(153)	0	(153)	S/O	S/O	S/O

Contrepartie	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]	Total de la juste valeur des instruments dérivés hors cote	Garantie (reçue)/nantie	Expositions nettes[1]
MYI	$ (2)	$ 10	$ 8	$ (197)	$ (60)	$ (257)
RBC	S/O	S/O	S/O	726	(460)	266
SCX	2 590	(2 250)	340	(3 904)	3 180	(724)
TOR	S/O	S/O	S/O	805	(630)	175
UAG	(101)	0	(101)	S/O	S/O	S/O

(1) L'exposition nette représente le montant net à recevoir/(à payer) qui serait dû de/à la contrepartie en cas de défaillance. Pour de plus amples informations sur les risques de crédit et de contrepartie, voir la Note 16, Risques financiers, des Notes relatives aux États financiers.

Informations comparatives

Voici une synthèse des informations comparatives concernant le Tableau des investissements au 31 décembre 2022 :

	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Valeurs mobilières admises à la cote d'une Bourse officielle	43,64	50,83
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	38,19	55,09
Autres valeurs mobilières	0,05	0,01
Fonds d'investissement	9,78	10,17
Contrats de mise en pension	6,69	0,06
Instruments financiers dérivés négociés sur un marché réglementé	0,04	(0,33)
Instruments financiers dérivés compensés	0,01	0,00
Instruments financiers dérivés hors cote	0,16	(0,10)
Contrats de prise en pension	S/O	(8,12)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	S/O	(8,97)

Le portefeuille d'investissement du Fonds se concentre sur les segments suivants au 31 décembre 2022 :

Investissements à la juste valeur	31 décembre 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Australie	1,66	0,22
Belgique	0,39	0,12
Bermudes	0,39	0,35
Îles Caïmans	3,83	3,47
Danemark	0,66	1,14
Finlande	0,38	0,23
France	2,56	0,36
Allemagne	1,17	0,39
Inde	S/O	0,82
Irlande	5,43	4,63
Israël	0,35	0,38
Italie	0,22	S/O
Japon	5,03	5,23
Luxembourg	0,10	0,08
Multinationales	S/O	0,04
Pays-Bas	3,03	1,12
Norvège	0,04	S/O
Arabie saoudite	0,11	0,10
Singapour	0,07	0,51
Corée du Sud	0,84	0,82
Espagne	0,42	0,03
Supranationales	1,10	1,06
Suisse	1,42	0,47
Émirats arabes unis	0,08	0,66
Royaume-Uni	8,42	10,25
États-Unis	42,70	72,26
Instruments à court terme	1,48	1,19
Fonds d'investissement	9,78	10,17
Contrats de mise en pension	6,69	0,06
Instruments financiers dérivés négociés sur un Marché réglementé		
Contrats à terme standardisés	0,04	(0,33)
Instruments financiers dérivés compensés		
Swaps de défaillance sur indices de crédit - achat de protection	0,01	0,00
Swaps de taux d'intérêt - Swaps de base	0,00	0,00
Instruments financiers dérivés hors cote		
Options vendues		
Options sur titres	S/O	0,00
Contrats de change à terme	(0,11)	(0,19)
Contrats de change à terme couverts	0,27	0,09
Autres actifs et passifs à court terme	1,44	(15,73)
Actif net	100,00	100,00

1. INFORMATIONS GÉNÉRALES

Chaque Fonds (appelé individuellement un « Fonds » et collectivement les « Fonds ») présenté dans ce rapport est un compartiment de PIMCO Funds: Global Investors Series plc (la « Société »), société à capital variable à compartiments multiples et responsabilité séparée entre les Fonds, immatriculée sous le numéro 276928 en vertu de la loi irlandaise de 2014 sur les sociétés (Companies Act) et agréée par la Banque centrale d'Irlande (la « Banque centrale »), conformément au Règlement de la Communauté européenne (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières) de 2011 (S.I. N° 352 de 2011), tel que modifié (le « Règlement OPCVM »). La Société est à compartiments multiples et constituée de différents Fonds, comprenant chacun une ou plusieurs catégories d'actions. Le Conseil d'administration de la Société (le « Conseil » ou les « Administrateurs ») peut, à son entière discrétion, émettre plusieurs catégories d'actions (« Catégorie ») pour un même Fonds. Un portefeuille d'actifs distinct est maintenu pour chaque Fonds et investi conformément aux objectifs et politiques d'investissement applicables pour ce Fonds. Le Conseil peut créer périodiquement des Fonds supplémentaires après accord préalable écrit de la Banque centrale. Le Conseil peut créer périodiquement des Catégories supplémentaires conformément aux exigences de la Banque centrale. La Société a été constituée le 10 décembre 1997.

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (le « Gestionnaire ») est le gestionnaire de la Société.

Comme prévu dans le Prospectus de la Société, Pacific Investment Management Company LLC, PIMCO Europe Ltd et PIMCO Europe GmbH (chacun un « Conseiller en investissement ») ont été nommés en tant que conseiller en investissement pour divers Fonds de la Société. PIMCO Asia Limited et PIMCO Asia Pte Ltd. (chacun, un conseiller en investissement) ont été validés par la Banque centrale pour agir en tant que conseiller en investissement pour les fonds irlandais.

Conformément au Prospectus de la Société, chaque Conseiller en investissement peut déléguer la gestion discrétionnaire des investissements des Fonds à un ou plusieurs conseillers en investissement par délégation, sous réserve de toutes les exigences légales et réglementaires applicables. Lorsqu'un Conseiller en investissement est nommé pour un ou des Fonds spécifique(s), le Conseiller en investissement nomme chacun des autres Conseillers en investissement, PIMCO Asia Limited et PIMCO Asia Pte Ltd., comme conseillers en investissement par délégation pour ce ou ces Fonds spécifique(s). Les commissions de chaque conseiller en investissement par délégation ainsi nommé seront payées par le Gestionnaire ou par les Conseillers en investissement au nom du Gestionnaire et prélevées sur les Frais de gestion.

Le siège social de la Société est sis au 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin 2, D02 HD32, Irlande.

2. PRINCIPALES MÉTHODES COMPTABLES

Ci-après figure une synthèse des principales méthodes comptables et des techniques d'estimation adoptées par la Société et appliquées dans le cadre de la préparation des présents états financiers :

(a) Base de préparation

Les états financiers sont préparés conformément à la norme FRS 102 (« FRS 102 »), « La norme de présentation de l'information financière applicable au Royaume-Uni et en République d'Irlande » émise par la Financial Reporting Council, à la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014 et à la Réglementation sur les OPCVM. Les états financiers sont préparés sur la base du principe continuité d'exploitation pour tous les Fonds.

Les informations devant figurer dans l'État de la totalité des gains et pertes constatés et un Rapprochement de la variation des fonds propres sont, selon l'opinion des Administrateurs, contenues dans le Compte de résultat et dans l'État de l'évolution des actifs nets.

La Société a fait usage de l'exemption offerte aux fonds d'investissement à capital variable qui détiennent une proportion considérable d'investissements hautement liquides et évalués à la juste valeur en vertu de la Section 7 de la norme FRS 102 et ne présente pas d'état des flux de trésorerie.

Les états financiers sont dressés selon la méthode du coût historique, telle que modifiée par la réévaluation des éléments d'actif et de passif financiers détenus à la juste valeur par résultat.

La Société tient des comptes distincts pour chaque Fonds. La Société émet des Actions et les affecte au Fonds choisi par l'actionnaire. Les produits d'une émission et les revenus qui en découlent sont crédités à chaque Catégorie de chaque Fonds proportionnellement à la valeur totale de chaque Catégorie. Lors d'un rachat, les actionnaires n'ont droit qu'à la fraction qui leur revient des actifs nets du Fonds au titre des actions émises en leur faveur.

La Société a adopté le dollar américain comme devise de présentation. Les états financiers de chaque Fonds sont préparés dans la devise fonctionnelle du Fonds respectif. En vertu de la loi irlandaise sur les sociétés, les totaux des Fonds pour la Société sont présentés en dollar américain, qui est la devise de l'environnement économique principal de la Société. Tous les montants sont exprimés en dollar américain, sauf indication contraire. Les états financiers des Fonds individuels sont convertis en dollar américain et cumulés pour la préparation des états financiers de la Société.

Le bilan de la Société est converti en appliquant les taux de change à la clôture de l'exercice, et le compte de résultat et l'état de l'évolution des actifs nets des Fonds sont convertis à un taux de change moyen (une approximation des taux réels) de l'exercice pour inclusion dans les états financiers des Fonds.

Les gains ou pertes de change sur la conversion des actifs nets à l'ouverture de l'exercice de la Société, et la différence moyenne de taux découlant de la conversion du Compte de résultat et de l'État de l'évolution des actifs nets de la Société, sont compris dans l'État de l'évolution des actifs nets de la Société. L'ajustement de conversion n'a aucun impact sur les actifs nets affectés aux Fonds individuels.

Tous les montants ont été arrondis au millier le plus proche, sauf indication contraire. Un solde égal à zéro peut représenter des montants réels inférieurs à mille qui ont été arrondis. Le Tableau des investissements de certains Fonds peut détenir des valeurs mobilières affichant une valeur nominale nulle et une juste valeur nulle, lorsque la valeur nominale et la juste valeur réelles sont arrondies au millier le plus proche.

(b) Détermination de la Valeur Nette d'Inventaire

La Valeur Nette d'Inventaire (« VNI ») de chaque Fonds et/ou chaque Catégorie est calculée à la clôture des négociations normales chaque Jour de négociation tel qu'indiqué dans le dernier Prospectus de la Société ou dans le supplément pertinent.

La Société a opté pour l'application des dispositions relatives à la comptabilisation et à l'évaluation visées dans la norme IAS (International Accounting Standard) n° 39 intitulée Instruments financiers : comptabilisation et évaluation et des obligations de communication et de présentation de la norme FRS 102 pour rendre compte de ses instruments financiers. Conformément à la norme IAS 39, les titres détenus dans le Fonds et ses autres éléments d'actif sont valorisés au cours moyen ou au dernier cours négocié au 31 décembre 2022 afin de déterminer les actifs nets attribuables aux porteurs d'actions de participation rachetables (les « Actifs nets »).

(c) Transactions sur titres et produits de placement

Les transactions sur titres sont comptabilisées à la date de transaction à des fins d'informations financières. Les titres achetés ou vendus avant l'émission ou à livraison différée peuvent être réglés après la période de liquidation habituelle pour le titre après la date de transaction. Les plus-values et moins-values réalisées sur des titres vendus sont comptabilisées au coût connu. Les produits des dividendes sont comptabilisés à la date ex-dividende, à l'exception de certains dividendes de titres étrangers dont la date ex-dividende peut être échue ; ils seront alors comptabilisés dès que le Fonds est informé de la date ex-dividende. Les produits des intérêts, ajustés pour accroissement des décotes et amortissement des primes, sont comptabilisés selon le principe de comptabilité d'exercice à compter de la date de règlement et calculés selon la méthodologie de détermination de l'intérêt réel, à l'exception des titres ayant une date d'entrée en vigueur différée, auquel cas les produits des intérêts sont comptabilisés selon le principe de comptabilité d'exercice à compter de la date d'entrée en vigueur. Pour les titres convertibles, les primes attribuables à la conversion ne sont pas amorties. Les gains (pertes) de remboursement sur les titres liés à des créances hypothécaires et autres titres adossés à des actifs, le cas échéant, sont comptabilisés comme des composants des produits des intérêts au Compte de résultat.

Les obligations peuvent être placées dans la catégorie des dettes improductives et les produits des intérêts correspondants peuvent être réduits par la cessation de la comptabilisation des intérêts courants et sortie du bilan des intérêts à recevoir lorsque le recouvrement de tout ou partie de ces intérêts est devenu douteux au vu des procédures appliquées régulièrement. Une obligation est retirée de la catégorie des dettes improductives quand son émetteur reprend le paiement des intérêts ou lorsque le recouvrement des intérêts est probable.

Les produits sont comptabilisés bruts de toute retenue à la source non récupérable/irrécouvrable et nets de tout crédit d'impôt. La retenue à la source est présentée séparément au Compte de résultat. Certains pays peuvent imposer des impôts sur les plus-values sur la vente d'investissements au Fonds. Les impôts sur les plus-values sont comptabilisés selon la comptabilité d'exercice et sont présentés séparément au Compte de résultat.

(d) Affectations à catégories multiples et Catégories d'Actions couvertes
Sauf indication contraire, chacune des Catégories d'un Fonds proposées par la Société dispose des mêmes droits en termes d'actifs et de privilèges de vote (si l'on exclut le fait que les actionnaires d'une Catégorie disposent de droits de vote exclusifs sur les questions liées uniquement à cette Catégorie). Dans chaque Catégorie de chaque Fonds, la Société peut émettre des Actions de distribution (Actions donnant droit aux bénéfices), des Actions de capitalisation (Actions donnant lieu à la capitalisation des bénéfices) et/ou des Actions de distribution II (Actions cherchant à distribuer un rendement amélioré). Cette structure à catégories multiples permet aux investisseurs de choisir la méthode d'acquisition d'actions qui leur convient le mieux, en fonction du montant de l'achat, de la durée de détention prévue des actions et d'autres critères. Lorsqu'une émission couvre des Actions de Catégories ou de types différents, la Valeur Nette d'Inventaire par action peut varier d'une Catégorie à l'autre, du fait que les produits sont cumulés ou distribués, ou que les frais et commissions diffèrent. Les plus-values et moins-values réalisées et latentes de chaque Fonds sont affectées chaque jour à chaque Catégorie d'actions, au prorata des actifs nets de chaque Catégorie du Fonds concerné.

S'agissant des catégories d'actions couvertes (les « Catégories couvertes »), la Société prévoit de se couvrir contre les fluctuations des devises des Catégories couvertes par rapport aux autres devises, sous réserve des réglementations et des interprétations que la Banque centrale promulgue en tant que de besoin. Les Catégories couvertes ne peuvent faire l'objet d'un effet de levier du fait de ces opérations. Bien que la Société s'efforce de couvrir le risque de change, il ne saurait être garanti qu'elle y parviendra. Les opérations de couverture sont clairement rattachées à une Catégorie spécifique. Tous les coûts et gains/(pertes) de telles stratégies de couverture peuvent réduire sensiblement les avantages des actionnaires de la Catégorie couverte concernée si la devise de cette Catégorie tombe en deçà de la devise fonctionnelle et/ou de la devise dans laquelle la totalité ou une partie des actifs du Fonds concerné est libellée et couverte contre d'autres devises.

(e) Transactions en devise étrangère
Les états financiers de chaque Fonds sont présentés dans la devise de l'environnement économique principal sur lequel il opère (la « devise fonctionnelle »). Les Fonds de la Société ont tous la même devise fonctionnelle et la même devise de présentation.

En vertu de la loi irlandaise sur les sociétés, les totaux des Fonds pour la Société sont présentés en dollar américain, qui est la devise de l'environnement économique principal de la Société.

Les justes valeurs des titres, des positions de change et des autres éléments d'actif et passif étrangers sont converties dans la devise fonctionnelle de chaque Fonds, sur la base des taux de change en vigueur chaque jour ouvrable. Les fluctuations de la valeur des positions de change et des autres éléments d'actif et passif, qui résultent d'une fluctuation des taux de change, sont comptabilisées comme des plus ou moins-values latentes sur devises étrangères.

Les plus-values ou moins-values latentes découlant de la conversion de titres libellés dans une devise étrangère sont comptabilisées dans la Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit et les plus-values ou moins-values latentes découlant de la conversion d'instruments financiers dérivés libellés dans une devise étrangère sont comptabilisées dans la Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés dans le Compte de résultat.

Les gains et pertes de change découlant de la vente de titres libellés dans une devise étrangère sont comptabilisés dans la Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit et les gains ou pertes de change découlant de la vente d'instruments financiers dérivés libellés dans une devise étrangère sont inclus dans la Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés dans le Compte de résultat.

Les plus-values et moins-values réalisées entre une date de transaction et une date de règlement sur des acquisitions et des ventes de titres libellés dans des devises étrangères et d'instruments financiers dérivés sont comptabilisées en Plus-value/(moins-value) nette réalisée de change dans le Compte de résultat.

Certains Fonds, qui comportent une Catégorie couverte, concluent des contrats de change à terme destinés à compenser l'effet de la couverture au niveau du Fonds afin que la devise fonctionnelle soit exposée uniquement aux devises autres que la devise fonctionnelle.

(f) Frais de transaction
Les frais de transaction sont les frais encourus pour acheter des actifs et des passifs financiers à la juste valeur par résultat. Ils comprennent les commissions et frais versés aux mandataires, conseillers, courtiers et négociants. Les frais de transaction figurent au Compte de résultat aux postes Plus-value/(moins-value) nette réalisée et Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les valeurs mobilières, les fonds de placement, les contrats de mise en pension et les dépôts auprès d'établissements de crédit, et Plus-value/(moins-value) nette réalisée et Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés. Pour les titres à revenu fixe et certains instruments financiers dérivés, les frais de transaction ne sont pas identifiables séparément du prix d'achat du titre et ne peuvent donc pas être divulgués séparément.

(g) Péréquation
La Société applique la pratique comptable appelée péréquation du revenu. L'ajustement effectué au nom de la péréquation des revenus assure que la distribution des revenus entre les actionnaires ayant investi dans des catégories d'actions de distribution et de distribution II est proportionnelle à la période durant laquelle un tel investissement a eu lieu. Un montant égal à la part du prix d'émission par action qui reflète le revenu net (le cas échéant) accumulé mais non distribué jusqu'à la date d'émission des actions sera réputé constituer un paiement de péréquation et traité comme remboursé à l'actionnaire concerné (i) au rachat de ces actions avant le paiement du premier dividende correspondant ou (ii) lors du paiement du premier dividende auquel l'actionnaire avait droit au cours de la même période comptable que celle pendant laquelle les actions sont émises. Le paiement de tout dividende subséquent au paiement du premier dividende donné ou le rachat desdites actions subséquent au paiement du premier dividende sera réputé inclure le revenu net (le cas échéant) cumulé mais non versé jusqu'à la date du rachat ou de la déclaration de dividende concernés.

(h) Jugements et estimations comptables critiques
La préparation des états financiers en conformité avec la norme FRS 102 exige que les Administrateurs émettent des jugements, des estimations et des hypothèses qui affectent l'application des politiques comptables et les montants présentés des actifs, passifs, revenus et dépenses. Les résultats réels peuvent être différents de ces estimations. Les estimations et les hypothèses sous-jacentes sont passées en revue en permanence. Les révisions des estimations comptables sont enregistrées pendant la période pendant laquelle les estimations sont révisées et pendant les périodes futures touchées par ces révisions.

(i) Valeur Nette d'Inventaire ajustée
La Valeur Nette d'Inventaire ajustée (ou *Swing Pricing*) peut faire office de mécanisme efficace pour protéger les actionnaires contre l'éventuel impact dilutif que peuvent entraîner les coûts de transaction élevés associés à des entrées ou sorties nettes importantes. Conformément aux Statuts, les titres sous-jacents d'un Fonds cotés ou négociés sur un marché réglementé sont généralement évalués et valorisés en fonction du prix moyen ou du dernier prix négocié à la clôture. Toutefois, ces titres sont négociés en fonction des cours acheteur et vendeur. Plus il y aura d'écart entre ces cours acheteur et vendeur, plus l'impact sur la valorisation d'un Fonds sera important.

La Valeur Nette d'Inventaire est ajustée en recalculant à la hausse ou à la baisse la Valeur Nette d'Inventaire (VNI) par action en fonction d'un facteur d'ajustement dépendant de l'orientation des flux de trésorerie nets d'un Fonds donné. Ce facteur d'ajustement correspond au montant, défini par les Administrateurs, permettant d'ajuster la VNI par action à la hausse ou à la baisse afin de tenir compte des frais de transaction (tels que les charges fiscales et autres coûts et frais) qui seraient à payer sur l'acquisition ou la cession effective des actifs du Fonds concerné. Dans des conditions de marché normales, le facteur d'ajustement ne dépasse pas 2 % de la VNI par action initiale de tout Fonds. Toutefois, dans des circonstances de marché exceptionnelles, ce niveau peut monter jusqu'à 5 % maximum afin de protéger les intérêts des actionnaires. La VNI ajustée sera ensuite appliquée à toute souscription ou tout rachat reçu le Jour de négociation concerné. Les entrées nettes importantes entraînent un ajustement à la hausse de la VNI par action, et les sorties nettes importantes un ajustement à la baisse.

La Société procède à un ajustement de la Valeur Nette d'Inventaire lorsque les flux de trésorerie nets dépassent un seuil préalablement fixé par les Administrateurs, au-delà duquel ils estiment que le montant de la dilution causée par les coûts de transactions serait important pour le Fonds.

S'il y a ajustement de la Valeur Nette d'Inventaire, cela se fera au niveau du Fonds et non au niveau de la Catégorie concernée, car les coûts de transactions sont encourus au niveau du Fonds.

Au 31 décembre 2022, un ajustement de la Valeur Nette d'Inventaire avait été appliqué au Fonds Income Fund II. Aucun ajustement de la Valeur Nette d'Inventaire n'avait été appliqué à l'un des autres Fonds au 31 décembre 2021.

La VNI par action est indiquée à la Note 19 et peut inclure un ajustement de la Valeur Nette d'Inventaire. Les ajustements du swing price sont constatés au Bilan, au Compte de résultat ou dans l'État de l'évolution de l'actif net.

3. INVESTISSEMENTS À LA JUSTE VALEUR ET HIÉRARCHIE DE LA JUSTE VALEUR

Cette catégorie regroupe deux sous-catégories : les actifs et passifs financiers désignés par l'équipe de gestion en juste valeur par résultat lors de leur lancement, et ceux détenus à des fins de transaction. Les actifs et passifs financiers désignés à la juste valeur par résultat lors de leur lancement sont des instruments financiers qui ne sont pas classés aux fins de transaction mais gérés, et leur performance est évaluée à la juste valeur conformément à la stratégie d'investissement publiée par le Fonds. Les actifs ou passifs financiers détenus à des fins de transaction sont acquis ou encourus principalement dans le but de les vendre ou de les racheter à court terme. Les instruments financiers dérivés sont considérés comme étant détenus à des fins de transaction.

(a) Politiques d'évaluation des investissements

La politique des Fonds impose aux Conseillers en investissement (ou « PIMCO ») et aux Administrateurs d'évaluer les informations relatives à ces actifs et passifs financiers à la juste valeur parallèlement à d'autres informations financières connexes.

Les plus-values et moins-values associées à des changements de juste valeur dans la catégorie « actifs et passifs financiers à la juste valeur par résultat » sont inclus dans le Compte de résultat correspondant à l'exercice au cours duquel ils surviennent.

Les titres des Fonds et les autres actifs pour lesquels les cotations du marché sont disponibles immédiatement sont évalués à la juste valeur. La juste valeur est généralement déterminée sur la base des prix de clôture officiels ou des derniers prix de vente rapportés, ou s'il n'y en a pas, en fonction de cotations obtenues auprès de teneurs de marchés établis ou de prix (y compris des évaluations de prix) fournis par des services de cotation approuvés du Fonds, des systèmes de reporting de cotation et d'autres sources tierces (collectivement, les « Services de cotation »).

Les investissements initialement évalués en devises autres que la devise fonctionnelle du Fonds sont convertis en appliquant les taux de change fournis par les Services de cotation. Par conséquent, la VNI des actions du Fonds peut être affectée par les changements de valeur des devises par rapport à la devise fonctionnelle du Fonds. La valeur des titres négociés sur des marchés étrangers ou libellés dans des devises autres que la devise fonctionnelle du Fonds peut être largement influencée un jour où la bourse concernée n'est pas ouverte aux négociations et la VNI peut varier les jours où un investisseur n'est pas en mesure d'acheter, racheter ou échanger des actions.

Si la valeur d'un titre négocié uniquement sur une bourse étrangère a changé de manière substantielle après la clôture de la bourse principale ou du marché principal pour ce titre mais avant la clôture du jour de négociation, le titre sera alors valorisé à sa juste valeur sur la base des procédures établies et approuvées par le Conseil. Les titres qui ne sont pas négociés quand un Fonds est ouvert sont aussi valorisés à leur juste valeur. Un Fonds peut déterminer la juste valeur d'investissements sur la base d'informations fournies par des Services de cotation ou d'autres tierces parties, qui peuvent recommander des prix basés sur la juste valeur ou des ajustements en référence à d'autres titres, indices ou actifs. Si des prix basés sur la juste valeur sont requis et en déterminant les justes valeurs, un Fonds peut, parmi d'autres éléments, prendre en compte des événements significatifs (notamment des changements dans la valeur de titres ou d'indices sur titres) qui ont eu lieu après la clôture du marché pertinent et avant la fin du jour de négociation. Un Fonds peut recourir à des outils de modélisation fournis par des prestataires tiers pour déterminer la juste valeur des titres concernés par des événements importants. Les opérations de change peuvent permettre de négocier des titres étrangers lorsque la Société n'est pas ouverte pour les négociations, ce qui pourrait avoir un effet sur les investissements du Fonds si le Fonds est dans l'impossibilité d'acheter ou de vendre des actions. Les Fonds ont retenu des Services de cotation afin de déterminer la juste valeur de titres étrangers. Ce service peut utiliser des statistiques et des programmes fondés sur la performance historique des marchés et autres données autres économiques afin d'aider aux estimations de justes valeurs. Les estimations de justes valeurs utilisées par un Fonds pour des titres étrangers peuvent différer des valeurs réalisées lors de la vente de ces titres et la différence peut être significative dans les états financiers. Les prix de juste valeur peuvent impliquer des jugements subjectifs concernant la valeur d'un titre ou d'un autre actif, et les justes valeurs utilisées afin de déterminer la VNI d'un Fonds peuvent différer des prix cotés ou publiés, ou des prix utilisés par d'autres pour de mêmes investissements. De plus, l'utilisation de prix de juste valeur peut ne pas toujours entraîner des ajustements du prix des titres ou autres actifs détenus par un Fonds.

(b) Hiérarchie de la juste valeur

La Société doit divulguer la hiérarchie de la juste valeur, distincte pour les actifs et les passifs, dans laquelle les évaluations de la juste valeur sont classées. Les informations reposent sur une hiérarchie de la juste valeur selon trois niveaux pour les données utilisées dans les techniques d'évaluation permettant de calculer la juste valeur.

La juste valeur est définie comme le montant auquel un actif peut être échangé, un passif réglé ou un instrument de fonds propres octroyé peut être échangé entre parties informées et disposées à contracter dans des conditions de pleine concurrence. La divulgation d'une hiérarchie de la juste valeur doit être faite distinctement pour chaque grande catégorie d'actifs et de passifs et classe les évaluations de la juste valeur selon trois niveaux (Niveaux 1, 2 et 3). Les données ou la méthode utilisées ne représentent pas nécessairement une indication du risque associé à l'investissement dans ces titres. Les niveaux 1, 2 et 3 de la hiérarchie de la juste valeur sont les suivants :

- Niveau 1 — Cotations de marchés actifs ou de bourses de valeurs concernant des éléments d'actifs et de passif identiques.
- Niveau 2 — Autres données significatives observables y compris, sans s'y limiter, des cotations concernant des éléments d'actif ou de passif similaires de marchés actifs, des cotations concernant des éléments d'actif ou de passif identiques ou similaires de marchés non actifs, des données autres que des cotations observables pour les éléments d'actif ou de passif (comme les taux d'intérêt, les courbes de taux, les volatilités, les remboursements anticipés, les sévérités des pertes, les risques de crédit et les taux de défaillance) ou toute autre donnée corroborée par le marché.
- Niveau 3 — Données significatives non observables basées sur les meilleures informations disponibles compte tenu de la situation, si les données observables ne sont pas disponibles, y compris les hypothèses du Conseil, ou de personnes agissant selon ses instructions, qui servent à déterminer la juste valeur des investissements.

(c) Techniques de valorisation et hiérarchie de la juste valeur

Les méthodes de valorisation (ou « techniques ») et les données significatives utilisées pour déterminer les justes valeurs des instruments financiers classés en Niveau 1 et Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur sont les suivantes :

Les titres à revenu fixe, dont les obligations et billets d'entreprises, convertibles et municipales, les obligations d'agences américaines, les obligations du Trésor américain, les émissions souveraines, les prêts bancaires, les titres privilégiés convertibles et les obligations non américaines sont habituellement valorisés sur la base de cotations obtenues de courtiers et négociants ou sur la base de Services de cotation qui utilisent les cotations des courtiers-négociants, les échanges communiqués ou les valorisations estimées selon leurs modèles internes de cotation. Les modèles internes des Services de cotation utilisent des données observables comme les renseignements concernant les émetteurs, les taux d'intérêt, les courbes de taux, les remboursements anticipés, les risques/écarts de crédit, les taux de défaillance et les cotations d'actifs similaires. Les titres pour lesquels on utilise des techniques de valorisation et des données similaires à celles précitées appartiennent au Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur.

Certains titres à revenu fixe achetés sur une base de livraison différée ou d'engagement de rachat dans le cas d'une opération par vente et rachat dos-à-dos sont valorisés quotidiennement à la valeur de marché jusqu'à ce qu'ils soient réglés à la date de règlement à terme. Ils relèvent du Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur.

Les titres liés à des créances hypothécaires et ceux adossés à des actifs sont généralement émis en tranches ou catégories distinctes de titres au sein de chaque transaction. Ces titres sont également normalement évalués par des Services de cotation qui ont recours aux cotations des courtiers-négociants ou aux valorisations estimées par leurs modèles de cotation internes. Pour ces titres, ces modèles prennent habituellement en compte les attributs des niveaux des tranches, les données actuelles du marché, les flux de trésorerie estimés et les écarts basés sur les rendements de chaque tranche. Ils intègrent également la performance des garanties associées à la transaction, lorsque celle-ci est disponible. Les titres liés à des créances hypothécaires et ceux adossés à des actifs auxquels on applique des techniques de valorisation similaires et les données précitées appartiennent au Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur.

Les actions ordinaires, les Fonds négociés en bourse (ETF), les billets négociés en bourse et les instruments financiers dérivés, comme les contrats à terme standardisés, les droits et bons de souscription ou les options sur contrats à terme standardisés négociés sur une bourse de valeurs nationale, sont présentés à la dernière vente réalisée ou au prix de règlement le jour de la valorisation. Si ces titres font l'objet d'échanges actifs et qu'aucun ajustement de la valorisation n'est pratiqué, ils appartiennent au Niveau 1 de la hiérarchie de la juste valeur.

Il est possible de pratiquer des ajustements de certains titres négociés uniquement sur une bourse de valeurs étrangère pour tenir compte des mouvements du marché entre la clôture du marché étranger et celle de la Bourse de New York. Ces titres sont valorisés sur la base de Services de cotation qui tiennent compte de la corrélation entre les modèles de négociation des valeurs étrangères données et les échanges intrajournaliers sur les marchés américains des investissements. Les titres qui font l'objet d'ajustements de valorisation appartiennent au Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur. Les titres privilégiés et autres actions négociés sur des marchés non actifs ou valorisés par référence à des instruments similaires appartiennent également au Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur.

Des ajustements de valorisation peuvent être appliqués à certains contrats à terme standardisés et options négociés en bourse pour tenir compte des fluctuations du marché entre le règlement des opérations de change et la clôture de la Bourse de New York. Ces titres sont évalués en utilisant des cotations obtenues à partir d'un système de reporting de cotation, de teneurs de marchés établis ou de services de cotation. Les instruments financiers dérivés qui font l'objet de ces ajustements de valorisation appartiennent au Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur.

Les investissements dans des sociétés d'investissement à capital variable enregistrées (autres que des ETF) sont valorisés sur la base de la VNI des investissements et appartiennent au Niveau 1 de la hiérarchie de la juste valeur. Les investissements dans des sociétés d'investissement à capital variable non enregistrées sont calculés par rapport à la VNI de ces investissements. Ils appartiennent au Niveau 1, sous réserve que la VNI soit observable, calculée quotidiennement et corresponde à la valeur à laquelle les achats et les ventes seront réalisés.

La valeur des instruments financiers dérivés hors cote, comme les contrats de change à terme, les contrats d'options ou les contrats de swaps, provient du prix des actifs, des indices, des taux de référence et autres données sous-jacentes ou d'une combinaison de ces facteurs. Ces contrats sont normalement valorisés selon les cotations des courtiers-négociants ou les données des Services de cotation. Selon le produit et les modalités de la transaction, la valeur des contrats d'instruments financiers dérivés peut être estimée par des Services de cotation qui ont recours à un ensemble de données observées sur les marchés réglementés actifs, comme les renseignements afférents aux émetteurs, les indices, les écarts, les taux d'intérêt, les courbes, les dividendes et les taux de change. Les instruments financiers dérivés valorisés selon des techniques de valorisation et des données similaires à celles précitées appartiennent au Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur.

La valeur des options sur actions négociées en bourse et des instruments financiers dérivés hors cote, tels que les contrats de change à terme et les contrats d'options dépend du prix des actifs, des indices, des taux de référence et autres données sous-jacentes ou d'une combinaison de ces facteurs. Ces contrats sont normalement valorisés en fonction de cotations obtenues à partir d'un système de reporting de cotation, de teneurs de marchés établis ou de Services de cotation (normalement définis à la clôture de la Bourse de New York). En fonction du produit et des modalités de la transaction, les instruments financiers dérivés peuvent être valorisés par les Services de cotation en appliquant un ensemble de techniques, y compris des modèles de simulation de cotation. Les modèles de cotation utilisent des données observées sur les marchés règlementés actifs, tels que les cours cotés, les détails de l'émetteur, les indices, les écarts entre les cours acheteurs et vendeurs, les taux d'intérêt, les volatilités implicites, les courbes de taux, les dividendes et les taux de change. Les instruments financiers dérivés qui utilisent des techniques et des données de valorisation similaires à celles décrites ci-dessus relèvent du Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur.

Les swaps compensés cotés ou négociés sur une plate-forme multilatérale ou une facilité d'échange, telle une bourse enregistrée, sont valorisés au prix de règlement journalier déterminé par les bourses respectives. La facilité qui compense les swaps de défaillance impose à ses membres de fournir des niveaux exploitables dans l'ensemble des modalités. Ces niveaux, ainsi que les valorisations des tiers servent à produire des prix de règlement quotidiens. Ces titres appartiennent au Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur. Les swaps de taux d'intérêt compensés sont valorisés selon un modèle de valorisation qui fait référence aux taux sous-jacents, y compris le taux de swap au jour le jour et le taux LIBOR à terme. Ces titres appartiennent au Niveau 2 de la hiérarchie de la juste valeur.

Actifs et passifs négociables de Niveau 3 à la juste valeur Quand une méthode de valorisation de la juste valeur est appliquée par PIMCO et utilise des données significatives non observables, une méthode que le Conseil ou les personnes agissant sur ses ordres estiment refléter la juste valeur sera utilisée pour évaluer les investissements et ceux-ci seront classés au Niveau 3 de la hiérarchie de la juste valeur. Les techniques d'évaluation et les données significatives utilisées pour déterminer les justes valeurs des actifs et instruments financiers du Fonds classés au Niveau 3 de la hiérarchie de la juste valeur sont les suivantes :

Les procédures de valorisation par procuration établissent le prix de base d'un titre à revenu fixe et ajustent ultérieurement le prix proportionnellement aux évolutions de la juste valeur d'un titre prédéterminé jugé comparable en termes de duration, généralement un bon du Trésor américain ou un billet souverain basé sur le pays d'émission. Le prix de base peut être une cotation d'un courtier-négociant, un prix de transaction ou une valeur interne dérivée de l'analyse des données de marché. Le prix de base peut être réactualisé périodiquement en fonction de la disponibilité des données de marché et des procédures approuvées par le Comité de surveillance des évaluations (Valuation Oversight Committee) de PIMCO. Des évolutions importantes des données non observables du processus de valorisation par procuration (le prix de base) entraîneraient des changements proportionnels et directs de la juste valeur du titre. Ces titres appartiennent au Niveau 3 de la hiérarchie de la juste valeur.

Si des prix de fournisseurs évalués par des tiers ne sont pas disponibles ou ne sont pas jugés indicatifs d'une juste valeur, PIMCO peut choisir d'obtenir des cotations de courtier directement auprès d'un courtier-négociant ou transmis par le biais d'une tierce partie. Si la juste valeur est basée sur une cotation de courtier provenant d'une source unique, ces titres appartiennent au Niveau 3 de la hiérarchie de la juste valeur. Les cotations de courtiers sont généralement reçues de participants au marché établis. PIMCO n'a aucune transparence pour consulter les données sous-jacentes qui soutiennent les cours de marché, même si elles sont reçues indépendamment. Des modifications importantes de la cotation du courtier auraient un effet direct et proportionnel sur la juste valeur du titre.

L'évaluation de l'instrument de référence estime la juste valeur en corrélant le titre à un ou plusieurs titres diversifiés, des indices de marché, et/ou des instruments financiers, dont les informations de cotation sont disponibles immédiatement. Les données non observables peuvent comprendre celles utilisées dans les algorithmes basés sur le changement de pourcentage dans les instruments de référence et/ou les pondérations de chaque instrument de référence. Des modifications importantes des données non observables auraient un effet direct et proportionnel sur la juste valeur du titre. Ces titres appartiennent au Niveau 3 de la hiérarchie de la juste valeur.

L'évaluation de l'analyse fondamentale estime la juste valeur en utilisant un modèle interne qui utilise des états financiers de la société sous-jacente non publique. Des modifications importantes des données non observables auraient un effet direct et proportionnel sur la juste valeur du titre. Ces titres appartiennent au Niveau 3 de la hiérarchie de la juste valeur.

Les instruments de créance à court terme (tels que les billets de trésorerie) ayant une maturité résiduelle de 60 jours maximum peuvent être évalués selon la méthode du coût amorti, tant que la valeur au coût amorti de tels instruments de créance à court terme est approximativement la même que la juste valeur de l'instrument telle que déterminée sans l'utilisation de l'évaluation au coût amorti. Ces titres appartiennent au Niveau 2 ou au Niveau 3 de la hiérarchie de la juste valeur en fonction de la source du prix de base.

4. TITRES ET AUTRES INVESTISSEMENTS

(a) Liquidités

Les liquidités sont évaluées à leur valeur nominale majorée des intérêts courus, le cas échéant. Tous les soldes bancaires des liquidités sont détenus soit par State Street Bank and Trust Co. ou directement auprès d'un dépositaire par délégation.

(b) Investissements dans des Fonds centraux

Certains Fonds peuvent également investir dans le Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund, un compartiment de PIMCO Select Funds plc, dans le cadre de leurs opérations de gestion de trésorerie. Les principaux investissements du Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund sont des instruments du marché monétaire et des instruments à revenu fixe à court terme. Le Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund peut supporter des frais liés à ses activités d'investissement, mais les Fonds PIMCO Funds n'investissent que dans la Catégorie Z et ne payent donc aucuns Frais de gestion.

(c) Investissements dans des titres

Les Fonds peuvent avoir recours aux investissements et stratégies décrits ci-dessous dans les limites fixées par les politiques d'investissement des Fonds.

Transactions à livraison différée Certains Fonds achètent ou vendent parfois des titres à livraison différée. Ces transactions impliquent l'engagement d'un Fonds à acheter ou vendre des titres à un prix ou un rendement prédéterminé, le paiement et la livraison ayant lieu après la période de liquidation d'usage. Lorsque des transactions à livraison différée sont en cours, le Fonds affecte ou reçoit en garantie des actifs liquides en quantité suffisante pour couvrir le prix d'achat ou les obligations concernées. Lors de l'achat d'un titre à livraison différée, le Fonds assume les droits et risques liés à la propriété du titre, y compris les risques de fluctuations de prix et de rendement, et prend ces fluctuations en compte pour déterminer sa Valeur Nette d'Inventaire. Un Fonds peut céder ou renégocier une transaction à livraison différée après sa conclusion, ce qui peut entraîner une plus-value ou une moins-value. Lorsqu'un Fonds vend un titre à livraison différée, il ne participe pas aux plus-values et moins-values ultérieures afférentes au titre en question.

Fonds négociés en bourse Certains Fonds peuvent investir dans des fonds négociés en bourse (« ETF ») qui sont, en général, des sociétés d'investissement basées sur des indices qui détiennent la quasi-totalité de leurs actifs dans des titres qui représentent leur indice spécifique, mais peuvent aussi être des sociétés d'investissement à gestion active. Les actions d'ETF sont négociées durant la journée sur une bourse et représentent un investissement dans un portefeuille de titres et d'actifs. En tant qu'actionnaire d'une autre société d'investissement, le Fonds supporterait sa part au prorata des frais d'investissement de l'autre société, y compris les commissions de conseil, en plus des frais qu'il supporte directement dans le cadre de ses propres opérations.

Obligations indexées sur l'inflation Certains Fonds peuvent investir dans des obligations indexées sur l'inflation qui sont des titres à revenu fixe dont la valeur du principal est régulièrement ajustée en fonction du taux d'inflation. Le taux d'intérêt assorti à ces obligations est généralement fixé à l'émission à un niveau inférieur à celui des obligations classiques. Toutefois, les intérêts sont acquittés sur toute la durée de vie d'une obligation indexée sur l'inflation, sur la base de la valeur du principal ajustée pour tenir compte de l'inflation. Toute hausse ou baisse du principal d'une obligation indexée sur l'inflation sera considérée comme un produit des intérêts dans le Compte de résultat, même si l'investisseur ne reçoit pas le principal avant l'échéance. Certaines obligations indexées sur l'inflation garantissent le remboursement du principal de l'obligation à l'échéance initial (ajusté en fonction de l'inflation). Dans le cas des obligations qui ne fournissent pas de telle garantie, la valeur du principal ajustée de l'obligation remboursée à l'échéance peut être en dessous de la valeur initiale.

Crédits consortiaux et cessions Certains Fonds investissent parfois dans des instruments de créance directs, qui sont des intérêts sur des montants dus par des emprunteurs privés, publics ou autres à des prêteurs ou des syndicats de prêteurs. Les investissements d'un Fonds dans des prêts peuvent prendre la forme de participations dans des crédits ou cessions de tout ou partie de crédits émis par des tiers. Un prêt est souvent administré par une banque ou un autre établissement de crédit (le « prêteur ») qui agit en tant qu'agent de tous les porteurs. L'agent administre les conditions du prêt en vertu des modalités du contrat de prêt. Un Fonds peut investir dans des séries multiples ou des tranches de prêt qui peuvent comporter différentes modalités et des risques associés différents. Lorsqu'un Fonds achète des cessions à des prêteurs, il acquiert des droits directs sur l'emprunteur. Ces prêts peuvent comprendre des participations à des « prêts relais », qui sont des emprunts contractés par des emprunteurs pour une courte période (en général moins d'un an) en attendant la mise en place d'arrangements de financement plus permanents tels que, par exemple, l'émission d'obligations, souvent à rendement élevé et émises afin de réaliser des acquisitions.

Les types de prêts et investissements connexes dans lesquels un Fonds peut investir comprennent, entre autres, les prêts de premier ordre, les prêts subordonnés (y compris les prêts de second rang, B-Notes et prêts mezzanine), les prêts complets, les prêts immobiliers commerciaux et autres prêts commerciaux et structurés. Dans le cas de prêts subordonnés, les dettes de rang supérieur à l'obligation de l'emprunteur vis-à-vis du détenteur de ce prêt peuvent être substantielles, même en cas d'insolvabilité de l'emprunteur. Les prêts mezzanine sont généralement garantis par le nantissement d'une participation dans l'emprunteur du crédit hypothécaire propriétaire du bien immobilier plutôt que d'un intérêt dans une créance hypothécaire.

Les investissements dans des prêts peuvent comprendre des engagements de prêts non financés, qui sont des obligations contractuelles de financement. Les engagements de prêts non financés peuvent comprendre des facilités de crédit renouvelables susceptibles d'obliger les Fonds à fournir des liquidités supplémentaires à l'emprunteur sur sa demande. Ces engagements représentent une obligation future totale, même si un pourcentage des montants engagés des prêts ne sera jamais utilisé par l'emprunteur. Lorsqu'il investit dans un crédit consortial, un Fonds est en droit de percevoir des paiements de principal, d'intérêt et de commissions uniquement de la part du prêteur qui vend le contrat de prêt et uniquement à réception par le prêteur des paiements de l'emprunteur. Un Fonds peut recevoir une commission d'engagement basée sur la partie non tirée de la part de la ligne de crédit sous-jacente d'un prêt à taux variable. Dans certaines circonstances, un Fonds peut recevoir une commission de pénalité lors du remboursement anticipé d'un prêt à taux variable par un emprunteur. Les commissions reçues/payées sont respectivement comptabilisées comme éléments des produits des intérêts ou des frais des intérêts dans le Compte de résultat.

Les engagements de prêts non financés au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 sont comptabilisés au passif du Bilan au poste À payer sur investissements achetés.

Titres liés à des créances hypothécaires et autres titres adossés à des actifs Certains Fonds peuvent investir dans des titres liés à des créances hypothécaires et autres titres adossés à des actifs qui représentent directement ou indirectement une participation dans, ou qui sont garantis et payables par, des prêts sur des actifs immobiliers. Les titres liés à des créances hypothécaires sont créés par des pools de prêts résidentiels ou commerciaux, y compris des prêts hypothécaires accordés par des institutions d'épargne et de crédit, des banques hypothécaires, des banques commerciales et autres. Ces titres fournissent un paiement mensuel constitué des intérêts et du principal. Les intérêts sont déterminés selon des taux fixes ou variables. Le taux de remboursement anticipé des créances hypothécaires sous-jacentes influera sur le prix et la volatilité d'un titre lié à une créance hypothécaire ; il pourra également avoir un effet sur le raccourcissement ou l'allongement de la duration réelle du titre par rapport aux prévisions au moment de l'achat. Le paiement en temps voulu du principal et des intérêts de certains titres liés à des créances hypothécaires est garanti par la bonne foi et le crédit du gouvernement américain. Les pools créés et garantis par des émetteurs non gouvernementaux, y compris les sociétés parrainées par le gouvernement, peuvent être supportés par diverses formes d'assurance et de garantie, mais il ne peut être garanti que les assureurs ou les garants privés pourront satisfaire leurs obligations aux termes des polices d'assurance ou des contrats de garantie. L'investissement dans des titres liés à des créances hypothécaires garantis par des prêts hypothécaires commerciaux présente des risques, ceux-ci représentent l'impact des conditions locales et économiques sur le marché de l'immobilier, la capacité des locataires à payer leur loyer et celle d'un bien à attirer et conserver les locataires. Ces titres peuvent être moins liquides et afficher une plus grande volatilité des cours que les autres types de titres liés à des créances hypothécaires ou adossés à des actifs. D'autres titres adossés à des actifs sont créés à partir de différents types d'actifs, y compris les prêts automobiles, les comptes débiteurs, tels que les créances de cartes de crédit et de comptes hospitaliers, les prêts immobiliers, les prêts étudiants, les prêts pour un bateau ou une résidence mobile, les prêts pour un camping-car, les prêts pour des logements préfabriqués, les crédits-bails d'aéronefs, les crédits-bails d'ordinateurs et les prêts bancaires syndiqués.

Les Titres de dette garantie (« CDO ») comprennent les obligations garanties (« CBO »), les prêts garantis (« CLO ») et autres titres de structure similaire. Les CBO et CLO font partie des titres adossés à des actifs. Une CBO est un trust adossé à un pool diversifié de titres à revenu fixe à haut risque, d'une qualité inférieure à « investment grade ». Un CLO est un trust garanti habituellement par un pool de prêts qui peuvent comprendre, entre autres, des prêts garantis de premier ordre nationaux et étrangers, des prêts de premier ordre non garantis et des prêts d'entreprises subordonnés, notamment les prêts dont la notation peut être inférieure à « investment grade » ou des prêts non notés équivalents. Le risque associé à l'investissement dans des CDO dépend essentiellement du type de titres garantis et de la catégorie de CDO dans laquelle le Fonds investit. Les CBO, CLO et autres CDO comportent des risques supplémentaires dont, sans limitation, (i) la possibilité que les distributions afférentes aux titres garantis ne soient pas suffisantes pour verser les intérêts ou autres paiements, (ii) la garantie peut subir une baisse de sa qualité ou être l'objet d'une défaillance, (iii) le Fonds peut investir dans des CBO, CLO ou d'autres CDO subordonnées à d'autres catégories, et (iv) la structure complexe du titre peut ne pas être parfaitement comprise au moment de l'investissement et donner lieu à des litiges avec l'émetteur ou à des résultats d'investissements inattendus.

Les Obligations hypothécaires garanties (« CMO ») sont des titres de créance d'une entité juridique garantis par des prêts hypothécaires entiers ou par des obligations hypothécaires privées et divisés en catégories. Les CMO sont structurées en multiples catégories, appelées souvent « tranches », chacune d'elles ayant une échéance et un calendrier de paiements du principal et des intérêts, y compris les prépaiements, différents. Les CMO peuvent être moins liquides et afficher une plus grande volatilité des cours que les autres types de titres liés à des créances hypothécaires ou adossés à des actifs.

Les titres adossés à des créances hypothécaires à coupon détaché (« SMBS ») sont des titres hypothécaires dérivés à catégories multiples. Les SMBS sont généralement structurées en deux catégories qui reçoivent des parts différentes des distributions d'intérêts et de principal d'un pool d'actifs hypothécaires.

Un SMBS aura une catégorie qui recevra l'ensemble des intérêts (catégorie « intérêts uniquement ») alors que l'autre recevra l'ensemble du principal (catégorie « principal uniquement »). Les paiements reçus pour la catégorie « intérêts uniquement » sont compris dans les produits des intérêts du Compte de résultat. Du fait du solde nul du principal à recevoir à l'échéance d'une catégorie « intérêts uniquement », des ajustements sont apportés tous les mois au coût du titre jusqu'à l'échéance. Ces ajustements sont compris dans le poste produits des intérêts du Compte de résultat. Les paiements reçus pour la catégorie « principal uniquement » viennent en déduction du coût et de la valeur nominale des titres.

Titres à rémunération en nature Certains Fonds peuvent investir dans des titres à rémunération en nature (« PIK »). Les PIK peuvent offrir à l'émetteur l'option, à chaque date de paiement des intérêts, d'effectuer les paiements d'intérêts en numéraire et/ou en titres de créance supplémentaires. Ces titres de créance supplémentaires ont normalement les mêmes caractéristiques, y compris d'échéance, de taux d'intérêt et de risques associés, que les obligations d'origine. Les cotations quotidiennes des obligations d'origine peuvent inclure les intérêts courus (appelées « dirty price ») et figurent au Bilan au poste Actif financier à la juste valeur par résultat sur valeurs mobilières.

Titres émis par des Agences du gouvernement américain ou des entreprises parrainées par le gouvernement américain Certains Fonds peuvent investir dans des titres d'agences du gouvernement américain ou d'entreprises parrainées par le gouvernement américain. Les titres du gouvernement américain sont des dettes du gouvernement américain, de ses organismes ou agences et, dans certains cas, garanties par ces derniers. Certains titres du gouvernement américain, tels que les bons, les billets et les obligations du Trésor, et les titres garantis par la Government National Mortgage Association (« GNMA » ou « Ginnie Mae »), sont soutenus par la bonne foi et le crédit du gouvernement des États-Unis ; d'autres, tels que ceux des Federal Home Loan Banks, sont soutenus par le droit de l'émetteur d'emprunter auprès du Département du Trésor américain (le « Trésor américain ») ; et d'autres, tels que ceux de la Federal National Mortgage Association (« FNMA » ou « Fannie Mae »), sont soutenus par le pouvoir discrétionnaire du gouvernement américain d'acheter les obligations de l'agence. Les titres du gouvernement américain peuvent comprendre des titres à coupon zéro. Les titres à coupon zéro ne distribuent pas d'intérêts et tendent à être soumis à un risque plus grand que les titres qui paient des intérêts.

Les garants liés au gouvernement (c'est-à-dire non garantis par la bonne foi et le crédit du gouvernement des États-Unis) comprennent la FNMA et la Federal Home Loan Mortgage Corporation (« FHLMC » ou « Freddie Mac »). La FNMA est une entreprise parrainée par le gouvernement. La FNMA achète des prêts hypothécaires résidentiels classiques (c'est-à-dire non assurés ou garantis par une agence du gouvernement) à partir d'une liste de vendeurs/agents serveurs agréés comprenant des associations d'épargne et de prêts agréées par les États ou le gouvernement fédéral, des banques mutuelles d'épargne, des banques commerciales, des sociétés de crédit mutuel et des établissements de crédit foncier. Les titres à flux identique émis par la FNMA sont garantis quant au paiement en temps voulu du principal et des intérêts par la FNMA, mais ne sont pas soutenus par la bonne foi et le crédit du gouvernement américain. La FHLMC émet des certificats de participation (« Participation Certificates », PC) qui sont des titres à flux identique, chacun représentant une participation indivise dans un pool de prêts hypothécaires résidentiels. La FHLMC garantit le paiement des intérêts et le recouvrement du principal en temps voulu, mais les PC ne sont pas soutenus par la bonne foi et le crédit du gouvernement américain.

En juin 2019, la FNMA et la FHLMC ont commencé à émettre des titres adossés à des créances hypothécaires uniformes (UMBS) à la place de leurs offres actuelles de titres éligibles TBA (la « Single Security Initiative »). La Single Security Initiative vise à soutenir la liquidité globale du marché TBA et à aligner les caractéristiques des certificats FNMA et FHLMC. Les effets que la Single Security Initiative peut avoir sur le marché pour les titres TBA et autres titres adossés à des créances hypothécaires sont incertains.

Un Fonds peut recourir à des stratégies de « roll-timing » afin de repousser l'expiration ou l'échéance d'une position comme un titre « to-be-announced » (« TBA ») sur un actif sous-jacent, en fermant la position avant expiration et en ouvrant une nouvelle position assortie d'une date d'expiration plus tardive sur le même actif sous-jacent. Les titres TBA achetés ou vendus figurent à l'actif ou au passif du Bilan, selon le cas.

Sociétés d'investissement immobilier (« Real Estate Investment Trusts » ou « REIT ») Certains Fonds peuvent investir dans des REIT, des véhicules de placements collectifs qui possèdent et généralement exploitent des biens immobiliers générateurs de revenus. Si un REIT remplit certaines conditions, notamment la distribution aux actionnaires de la quasi-totalité des revenus imposables (autres que des plus-values nettes), il n'est pas imposé sur les revenus distribués aux actionnaires. Les distributions reçues de la part des REIT peuvent être considérées comme des revenus, des plus-values ou un remboursement de capital. Un remboursement de capital est enregistré par le Fonds comme une réduction de la structure de coûts de ses investissements dans le REIT. Les REIT sont assujettis à des frais de gestion et autres frais, ainsi les Fonds qui investissent dans des REIT assumeront leur part proportionnelle des coûts d'exploitation de ces REIT.

Titres sujets à restrictions Certains Fonds peuvent investir dans des titres dont la revente est soumise à des restrictions légales ou contractuelles. Ils peuvent généralement être vendus de manière privée, mais ils doivent être enregistrés ou dispensés d'enregistrement avant d'être vendus au public. Les titres de placements privés sont généralement considérés comme des titres sujets à restrictions. La cession de titres sujets à restrictions peut impliquer des négociations longues, ainsi que des frais et il peut s'avérer difficile de les vendre rapidement à un prix convenable. Les titres sujets à restrictions détenus par les Fonds au 31 décembre 2022 figurent dans les Notes relatives au Tableau des investissements.

Transactions avant l'émission Certains Fonds peuvent acheter ou vendre des titres avant leur émission. Ces opérations sont conditionnelles, puisqu'un titre, bien qu'il ait été autorisé, n'a pas encore été émis sur le marché. Les transactions d'achat ou de vente de titres avant leur émission impliquent qu'un Fonds s'engage à acheter ou vendre ces titres à un prix ou un rendement prédéterminé, le paiement et la livraison ayant lieu après la période de liquidation d'usage. Un Fonds peut vendre des titres avant leur émission avant qu'ils ne soient livrés, ce qui peut entraîner la réalisation d'une plus ou moins-value.

Obligations perpétuelles Certains Fonds peuvent investir dans des obligations perpétuelles, des titres à revenu fixe sans date d'échéance mais qui versent un coupon à perpétuité (sans date de fin ou d'échéance fixée). Contrairement aux titres à revenu fixe classiques, il n'existe aucune obligation pour les obligations perpétuelles de rembourser le principal. Le paiement des coupons est toutefois obligatoire. Bien que les obligations perpétuelles n'aient pas de date d'échéance, elles peuvent avoir une date de remboursement par anticipation à laquelle la perpétuité est supprimée et l'émetteur peut restituer le principal reçu à la date d'achat spécifiée. En outre, une obligation perpétuelle peut avoir des caractéristiques supplémentaires, telles que des hausses de taux d'intérêt à des dates périodiques ou une augmentation à un moment prédéterminé à l'avenir.

Les bons de souscription sont des titres qui sont généralement émis en parallèle à un titre de créance ou un titre privilégié et qui garantissent à leur détenteur le droit d'acheter une quantité proportionnelle d'actions ordinaires à un prix fixé. Les bons de souscription ont normalement une durée de vie mesurée en années et permettent à leur détenteur d'acheter des actions ordinaires d'une société à un prix généralement supérieur au cours du marché au moment de l'émission des bons de souscription. Les bons de souscription peuvent comporter des risques plus importants que certains autres types d'investissements. En général, les bons de souscription ne donnent pas le droit de recevoir des dividendes ou d'exercer des droits de vote eu égard aux titres sous-jacents, et ils n'ouvrent aucun droit sur les actifs de l'émetteur. En outre, leur valeur n'évolue pas forcément selon la valeur des titres sous-jacents, et ils perdent leur valeur s'ils ne sont pas utilisés à leur date d'expiration ou avant celle-ci. Si le cours du marché de l'action sous-jacente ne dépasse pas le prix d'exercice pendant la durée de vie d'un bon de souscription, celui-ci arrivera à expiration en ayant perdu sa valeur. Les bons de souscription peuvent augmenter les bénéfices ou les pertes potentiels d'un investissement par rapport à un investissement du même montant dans les titres sous-jacents. De même, l'augmentation ou la diminution en pourcentage de la valeur d'un bon de souscription sur un titre de capital peut être supérieure à l'augmentation ou à la diminution en pourcentage de la valeur de l'action ordinaire sous-jacente. Les bons de souscription peuvent se rapporter à l'achat de titres de capital ou de créance. Les titres de créance assortis de bons de souscription liés à l'achat de titres de capital partagent de nombreuses caractéristiques avec les titres convertibles. Dans une certaine mesure, leur prix peut refléter la performance de l'action sous-jacente. Des titres de créance peuvent également être assortis de bons de souscription permettant l'achat de titres de créance supplémentaires au même taux de coupon. Une baisse des taux d'intérêt permettrait au Portefeuille de vendre à profit de tels bons de souscription. En revanche, en cas de hausse des taux d'intérêts, ces bons de souscription arriveraient à expiration en ayant perdu toute valeur.

5. EMPRUNTS ET AUTRES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT

Les Fonds peuvent contracter des emprunts et conclure d'autres opérations de financement décrites ci-dessous dans la mesure autorisée par les politiques d'investissement des Fonds.

Les paragraphes suivants contiennent des informations sur la capacité des Fonds à prêter ou emprunter des liquidités ou des titres en vertu des réglementations applicables de la Banque centrale et des dispositions du Prospectus, dans la mesure permise par les objectifs et politiques d'investissement des Fonds et sous réserve des limites périodiquement fixées par la Banque centrale et des dispositions du Prospectus, ce qui peut être considéré comme des opérations de financement ou des emprunts par les Fonds. La localisation de ces instruments dans les états financiers des Fonds est décrite ci-dessous :

(a) Contrats de mise en pension
Certains Fonds peuvent conclure des contrats de mise en pension. Selon les termes d'une mise en pension de titres classique, le Fonds prend possession d'un titre obligataire sous-jacent (« garantie ») à la condition que le vendeur s'engage à le racheter et que le Fonds le revende ensuite à un prix et une date convenus. Dans un contrat de mise en pension à échéance ouverte, il n'y a pas de date de rachat prédéterminée et le Fonds ou la contrepartie peuvent résilier le contrat à tout moment. Les titres sous-jacents de tous les contrats de mise en pension sont détenus par le dépositaire ou les dépositaires par délégation désignés du Fonds dans le cadre de contrats de mise en pension tripartites. Dans certains cas, ils resteront sous la garde de la contrepartie. La juste valeur de la garantie doit être égale ou supérieure au montant total des engagements de mise en pension, intérêts compris. Les contrats de mise en pension, y compris les intérêts courus, sont inclus dans le Bilan. Les intérêts perçus sont enregistrés comme éléments des produits des intérêts dans le Compte de résultat. En période de demande accrue de garanties, un Fonds peut payer des frais sur la réception de la garantie, ce qui entraînera des frais des intérêts pour le Fonds.

(b) Contrats de prise en pension
Certains Fonds ont parfois recours à des contrats de prise en pension. Dans un contrat de prise en pension, un Fonds livre un titre à un établissement financier (la contrepartie) en échange de numéraire, et convient simultanément de racheter le même titre ou un titre essentiellement identique à un prix et une date convenus. Dans un contrat de prise en pension à échéance ouverte, il n'y a pas de date de rachat prédéterminée et le Fonds ou la contrepartie peuvent résilier le contrat à tout moment. Un Fonds a droit au paiement du principal et des intérêts, le cas échéant, afférents au titre remis à la contrepartie pendant la durée du contrat. Le numéraire reçu en échange des titres livrés, augmenté des paiements d'intérêt courus devant être effectués par le Fonds à des contreparties figure au passif du Bilan. Les intérêts payés par le Fonds à des contreparties sont enregistrés comme éléments des frais des intérêts dans le Compte de résultat. En période de demande accrue du titre, le Fonds peut recevoir une commission pour son utilisation par la contrepartie, ce qui peut résulter en un produit des intérêts pour le Fonds. Le Fonds différenciera les actifs déterminés comme liquides par les Conseillers en investissement ou couvrira autrement ses obligations au titre des contrats de prise en pension.

(c) Ventes à découvert
Certains Fonds peuvent réaliser des transactions de vente à découvert. Une vente à découvert est une transaction dans laquelle le Fonds vend des titres qu'il ne possède pas en prévision d'un repli de la juste valeur desdits titres. Les titres vendus à découvert et les intérêts dus sur ces titres, le cas échéant, sont comptabilisés au passif du Bilan. Un Fonds est tenu de livrer les titres au cours de marché lors de la couverture de la position à découvert. Les pertes potentielles liées aux ventes à découvert peuvent être illimitées, alors que celles sur les achats ne peuvent être supérieures au montant total investi.

(d) Vente et rachat dos-à-dos
Certains Fonds peuvent conclure des transactions de financement appelées « vente et rachat dos-à-dos ». Dans une transaction de vente et rachat dos-à-dos, un Fonds vend un titre à un établissement financier (la contrepartie), et convient simultanément de racheter le même titre ou un titre essentiellement identique à un prix et une date convenus. Le Fonds n'a pas droit au paiement du principal et des intérêts, le cas échéant, afférents au titre vendu à la contrepartie pendant la durée du contrat. Le produit convenu des titres devant être rachetés par un Fonds figure au passif du Bilan. Le Fonds constate le revenu net représenté par l'écart de prix entre le prix reçu sur le titre transféré et le prix de rachat convenu. On l'appelle généralement « baisse de prix ». Une baisse de prix se compose (i) des ajustements du revenu abandonné des intérêts et de l'inflation que le Fonds aurait éventuellement perçus si le titre n'avait pas été vendu et (ii) des conditions de financement négociées entre le Fonds et la contrepartie. Les ajustements du revenu abandonné des intérêts et de l'inflation, le cas échéant, sont comptabilisés comme des composants des produits des intérêts au Compte de résultat. Les intérêts payés par le Fonds à des contreparties sur la base des conditions de financement négociées sont enregistrés en frais des intérêts dans le Compte de résultat. En période de demande accrue du titre, le Fonds peut recevoir une commission pour son utilisation par la contrepartie, ce qui peut résulter en un produit des intérêts pour le Fonds. Un Fonds différenciera les actifs déterminés comme liquides par les Conseillers en investissement ou couvrira autrement ses obligations au titre des transactions par vente et rachat dos-à-dos.

6. INSTRUMENTS FINANCIERS DÉRIVÉS

Les paragraphes suivants contiennent des informations sur la façon et la raison pour laquelle les Fonds utilisent des instruments financiers dérivés et l'impact de ces instruments sur la situation financière, le résultat d'exploitation et les flux de trésorerie des Fonds. Les instruments financiers dérivés en cours à la clôture de l'exercice qui figurent dans le Tableau des investissements et les montants des plus-values et moins-values réalisées au cours de la période et les variations des plus-values et moins-values latentes sur les instruments financiers dérivés qui figurent dans le Compte de résultat servent d'indicateurs du volume d'activité des instruments financiers dérivés des Fonds.

(a) Contrats de change à terme
Certains Fonds peuvent conclure des contrats de change à terme dans le cadre du règlement d'achats prévus ou de la vente de titres, afin de couvrir l'exposition aux devises associée à tout ou partie des titres d'un Fonds, ou dans le cadre d'une stratégie d'investissement. Un contrat de change à terme est un accord entre deux parties portant sur la vente et l'achat d'une devise à un prix défini à une date ultérieure. La juste valeur d'un contrat de change à terme fluctue en fonction de l'évolution des taux de change des devises. Les contrats de change à terme sont évalués quotidiennement à la valeur du marché et l'évolution de la valeur est comptabilisée par un Fonds en tant que perte ou gain latent(e). Les plus-values ou moins-values réalisées correspondent à la différence entre la valeur du contrat lors de son ouverture et sa valeur lors de sa clôture. Elles sont comptabilisées à livraison ou réception de la devise. Ces contrats peuvent comporter un risque de marché supérieur au gain ou à la perte latent(e) indiqué(e) dans le Bilan. En outre, un Fonds peut être exposé à un risque si les contreparties ne parviennent pas à respecter les dispositions du contrat ou si la valeur de la devise évolue de manière défavorable par rapport à la devise fonctionnelle. Pour atténuer ce risque, des montants en espèces ou des titres peuvent être échangés en garantie conformément aux termes des contrats sous-jacents.

Certains Fonds, qui comportent une catégorie couverte, concluent des contrats de change à terme destinés à compenser l'effet de la couverture au niveau du Fonds afin que la catégorie couverte soit exposée uniquement aux devises autres que la devise fonctionnelle. Il n'existe aucune garantie que ces contrats de change à terme propres à chaque catégorie seront un succès.

En ce qui concerne les catégories couvertes, les plus-values ou moins-values réalisées et latentes sont imputées uniquement aux catégories d'actions correspondantes. Les plus-values ou moins-values latentes se reflètent en tant que composants des instruments financiers dérivés au Bilan. Dans le cadre de ces contrats, les titres peuvent être identifiés en tant que garantie conformément aux conditions des contrats respectifs.

(b) Contrats à terme standardisés
Certains Fonds ont parfois recours à des contrats à terme standardisés. Un Fonds peut recourir à des contrats à terme standardisés afin de gérer son exposition aux marchés des valeurs mobilières ou aux fluctuations des taux d'intérêt et des devises. Les principaux risques associés au recours à des contrats à terme standardisés sont la corrélation imparfaite entre les fluctuations de la juste valeur des titres détenus par un Fonds, les prix des contrats à terme standardisés et l'éventualité d'un marché non liquide. Les contrats à terme standardisés sont évalués à leur cours de règlement journalier coté. Lors de la conclusion d'un contrat à terme standardisé, le Fonds doit effectuer un dépôt auprès du courtier du contrat à terme standardisé. Le dépôt est constitué de liquidités ou d'obligations du gouvernement américain ou d'agences américaines, ou de titres de créance souveraine sélectionnées, conformément aux exigences de marge initiale du courtier ou de la bourse. Les contrats à terme standardisés sont évalués quotidiennement à la valeur du marché et les montants débiteurs ou créditeurs liés à l'évolution de la valeur (« Marge des Instruments financiers dérivés ») sont comptabilisés par le Fonds. Les plus-values ou moins-values sont enregistrées, mais elles ne sont pas considérées comme réalisées tant que les contrats n'ont pas expiré ou ne sont pas clôturés. Les contrats à terme standardisés impliquent, à différents degrés, des risques de pertes supérieures à la Marge des Instruments financiers dérivés déclarée dans le Bilan.

(c) Contrats d'options
Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options à des fins d'optimisation des rendements ou pour couvrir une position existante ou un investissement futur. Un Fonds peut vendre des options d'achat ou de vente sur les titres et instruments financiers dérivés qu'il possède ou sur lesquels il peut investir. La souscription d'options de vente a tendance à accroître l'exposition du Fonds à l'instrument sous-jacent. La souscription d'options d'achat a tendance à diminuer l'exposition d'un Fonds à l'instrument sous-jacent. Lorsqu'un Fonds vend une option d'achat ou de vente, un montant égal à la prime reçue est comptabilisé en tant que passif puis évalué à la valeur de marché pour refléter la valeur en cours de l'option vendue.

Ces passifs sont compris dans le Bilan. Les primes perçues grâce à la souscription d'options qui expirent sont considérées comme des plus-values réalisées. Les primes perçues pour des souscriptions d'options exercées ou clôturées sont ajoutées aux produits ou portées en déduction des montants payés sur le contrat à terme standardisé sous-jacent, le swap sous-jacent, le titre sous-jacent ou la transaction sur devises sous-jacente, afin de déterminer la plus-value ou la moins-value réalisée. Certaines options sont parfois souscrites avec des primes qui seront déterminées ultérieurement. Les primes de ces options sont basées sur les paramètres de volatilité implicite aux conditions précisées. En tant que vendeur d'une option, un Fonds n'a aucun contrôle sur la vente ou l'achat effectif de l'instrument sous-jacent. Par conséquent, le Fonds assume le risque de marché lié à une évolution défavorable de l'instrument qui sous-tend l'option vendue. Il existe un risque que le Fonds ne puisse conclure une transaction de clôture en raison d'un marché non liquide.

Un Fonds peut également acheter des options de vente et d'achat. L'achat d'options d'achat a tendance à accroître l'exposition du Fonds à l'instrument sous-jacent. L'achat d'options de vente a tendance à réduire l'exposition du Fonds à l'instrument sous-jacent. Le Fonds paie une prime, incluse dans le Bilan en tant qu'actif, et qui est par la suite calculée par référence au marché afin de répercuter la valeur actuelle de l'option. Les primes versées pour l'achat d'options qui expirent sont considérées comme des moins-values réalisées. Certaines options sont parfois souscrites avec des primes qui seront déterminées à une date ultérieure. Les primes de ces options sont basées sur les paramètres de volatilité implicite aux conditions précisées. Le risque associé à l'achat d'options d'achat et de vente est limité à la prime versée. Les primes payées pour l'achat d'options exercées ou clôturées sont ajoutées aux montants payés ou portées en déduction des produits réalisés sur l'investissement sous-jacent, afin de déterminer la plus-value ou moins-value réalisée lorsque la transaction sous-jacente est effectuée.

Swaptions de défaillance Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des contrats de swaptions de défaillance pour couvrir l'exposition au risque de crédit d'un investissement sans engagement vis-à-vis de l'instrument sous-jacent. Une swaption de défaillance est une option de vente ou d'achat d'une protection de crédit avec une référence particulière via un contrat de swap prédéfini par une date future précisée.

Options de change Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options de change. La vente et l'achat d'options de change confèrent à un Fonds le droit, mais pas l'obligation, d'acheter ou de vendre la devise à un taux de change qui pourra être exercé au plus tard à une date définie. Ces options peuvent être utilisées comme couverture courte ou longue contre les variations possibles des taux de change ou pour obtenir une exposition à des devises étrangères.

Options plafonnées sur l'inflation Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options plafonnées sur l'inflation à des fins d'optimisation du rendement ou de couverture. Lorsqu'un Fonds vend une option plafonnée sur l'inflation, un montant égal à la prime reçue est comptabilisé en tant que passif puis évalué à la valeur de marché pour refléter la valeur en cours de l'option vendue. Lorsqu'un Fonds achète une option plafonnée sur l'inflation, il verse une prime comptabilisée en tant qu'actif puis évaluée à la valeur de marché pour refléter la valeur courante de l'option. L'achat d'options plafonnées sur l'inflation vise à protéger le Fonds de l'érosion due à l'inflation au-dessus d'un certain taux sur une exposition notionnelle donnée. Il est possible de recourir à un plancher pour avoir une protection contre la baisse pour des placements dans des produits indexés sur l'inflation.

Options à taux d'intérêt plafonnées Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options à taux d'intérêt plafonnées à des fins d'optimisation du rendement ou de couverture. Lorsqu'un Fonds vend une option à taux d'intérêt plafonnée, un montant égal à la prime reçue est comptabilisé en tant que passif puis évalué à la valeur de marché pour refléter la valeur en cours de l'option vendue. Lorsqu'un Fonds achète une option à taux d'intérêt plafonnée, il verse une prime comptabilisée en tant qu'actif puis évaluée à la valeur de marché pour refléter la valeur courante de l'option. L'achat d'options à taux d'intérêt plafonnées vise à protéger le Fonds du risque lié aux taux variables au-dessus d'un certain taux sur une exposition notionnelle donnée. Il est possible de recourir à un plancher pour protéger les placements dans des produits indexés sur les taux d'intérêt contre la baisse.

Options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options sur des contrats à terme standardisés négociés en bourse (« Options sur contrat à terme standardisé ») afin de couvrir une position existante ou un investissement futur, à des fins spéculatives ou pour gérer leur exposition aux fluctuations du marché. Une Option sur contrat à terme standardisé est un contrat d'option dans lequel l'instrument sous-jacent est un seul contrat à terme.

Options sur des contrats à terme standardisés de matières premières Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options sur des contrats à terme standardisés de matières premières (« Options sur matières premières »). L'instrument sous-jacent de l'Option sur matières premières n'est pas la matière première elle-même mais un contrat à terme standardisé sur cette matière première. L'exercice d'une Option sur matières premières ne comprend pas la livraison physique de la matière première sous-jacente, mais plutôt le règlement direct sur le compte de garde du Fonds de la différence entre la juste valeur courante du contrat à terme standardisé sous-jacent et le prix d'exercice. S'il s'agit d'une option dans le cours, le Fonds annulera normalement sa position au lieu d'exercer l'option afin de conserver la valeur restante avant la fin.

Options à barrière Certains Fonds peuvent vendre ou acheter diverses options à la structure de rémunération non standard ou présentant d'autres particularités (« Options à barrière »). Les Options à barrière sont généralement négociées hors cote. Un Fonds peut investir dans divers types d'Options à barrière notamment des options à barrière activante « down-and-in » et « up-and-in ». Ces options sont similaires à des options standard, mais elles expirent sans aucune valeur pour leur souscripteur si le prix de l'instrument sous-jacent atteint, ou n'atteint pas, un niveau barrière spécifique avant la date d'expiration de l'option.

Swaptions de taux d'intérêt Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des contrats de swaptions de taux d'intérêt, qui sont une option de conclusion d'un contrat de swap prédéfini à une date précise à l'avenir. Le vendeur d'une swaption devient la contrepartie au swap si l'acheteur exerce l'option. Le contrat de swaption de taux d'intérêt précisera si l'acheteur de la swaption sera le receveur ou l'acheteur d'un taux fixe au moment de l'exercice.

Options sur titres Certains Fonds peuvent vendre ou acheter des options sur titres à des fins d'optimisation du rendement ou pour couvrir une position existante ou un investissement futur. Une option sur un titre utilise un titre donné comme instrument sous-jacent du contrat d'option.

Options doubles Certains Fonds peuvent souscrire différentes formes d'options doubles (« Option double »). Une Option double est une stratégie qui combine des options qui permettent à un Fonds de bénéficier des futurs mouvements des cours du titre sous-jacent, quelle que soit la direction de ces mouvements. Une Option double vendue implique l'achat simultané d'une option d'achat et d'une option de vente, sur le même titre aux mêmes prix d'exercice et date d'expiration. Une Option double vendue prend de la valeur quand le prix du titre sous-jacent est peu volatil avant la date d'expiration. Une Option double achetée implique l'achat simultané d'une option d'achat et d'une option de vente sur un même titre aux mêmes prix d'exercice et date d'expiration. L'Option double achetée prend de la valeur si le prix du titre sous-jacent est très volatil, quelle que soit la direction de ces mouvements, avant la date d'expiration.

(d) Contrats de swap

Certains Fonds peuvent investir dans des contrats de swap. Les contrats de swaps sont des contrats négociés bilatéralement entre un Fonds et une contrepartie. Ils portent sur l'échange, ou swap, de flux de trésorerie, d'actifs, de devises ou de performances liées au marché à des intervalles futurs précisés. La négociation des contrats de swap est privée et a lieu sur le marché hors cote (« Swaps hors cote ») ou ils peuvent être compensés par un tiers, connu sous le nom de contrepartie centrale ou d'organisme de compensation des instruments financiers dérivés (« swaps compensés »). Un Fonds peut conclure un contrat de swap sur actifs, défaillance, devises croisées, taux d'intérêt, rendement total, de variance et autres afin de gérer son exposition aux risques de crédit, de change, de taux d'intérêt, de matières premières, d'actif et d'inflation. Dans le cadre de ces contrats, les titres ou espèces peuvent être acceptés en garantie ou à titre de marge conformément aux termes des contrats de swap respectifs afin de donner des actifs de valeur et un moyen de recours en cas de défaillance ou faillite/insolvabilité.

Les swaps compensés sont évalués quotidiennement à la valeur du marché sur la base de valeurs déterminées à partir du contrat sous-jacent ou conformément aux indications de la contrepartie centrale ou de l'organisme de compensation des instruments financiers dérivés. Les variations de la juste valeur, le cas échéant, figurent dans la Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente au Compte de résultat. Les variations quotidiennes de la valorisation des swaps compensés, le cas échéant, sont comptabilisées au débit ou au crédit, selon la variation (« Marge de variation des swaps »), du Bilan. Les paiements de swap hors cote reçus ou effectués au début de la période de valorisation figurent au Bilan et représentent les primes payées ou reçues lors de la conclusion du contrat de swap pour compenser les écarts entre les conditions des contrats de swap et les conditions de marché en vigueur (écarts de crédit, taux de change, taux d'intérêt et autres éléments pertinents).

Les primes reçues (payées) d'avance sont initialement comptabilisées au passif (à l'actif) puis évaluées à la valeur du marché afin de refléter la valeur courante du swap. Ces primes réglées à l'avance sont comptabilisées comme plus-value ou moins-value réalisée dans le Compte de résultat dès la résiliation ou l'échéance du swap. Un paiement de liquidation reçu ou effectué lors de la résiliation du swap est comptabilisé comme plus-value ou moins-value réalisée dans le Compte de résultat. Les paiements nets périodiques reçus ou effectués par les Fonds sont repris dans les plus-values ou moins-values réalisées du Compte de résultat.

Aux fins d'application de certaines des politiques et restrictions d'investissement du Fonds, les contrats de swap, comme d'autres instruments financiers dérivés, peuvent être évalués par le Fonds à leur juste valeur, à leur valeur notionnelle ou à leur valeur exposée au risque totale. Dans le cas d'un contrat de swap de défaillance (voir plus bas) cependant, lors de l'application des politiques et restrictions d'investissement du Fonds, celui-ci évalue le contrat de swap de défaillance à sa valeur notionnelle ou à sa valeur exposée au risque totale (la somme du montant notionnel du contrat plus sa juste valeur), mais peut évaluer le contrat de swap de défaillance à sa juste valeur pour l'application de certaines autres politiques et restrictions d'investissement du Fonds. Par exemple, un Fonds peut évaluer des contrats de swap de défaillance à leur valeur d'exposition au risque totale pour les besoins des lignes directrices du Fonds sur la qualité du crédit (si elles existent), car cette valeur reflète l'exposition économique réelle du Fonds pendant la durée du contrat de swap de défaillance. Dans ce contexte, le montant notionnel et la juste valeur peuvent être positifs ou négatifs selon que le Fonds est acheteur ou vendeur de protection par le biais du contrat de swap de défaillance. La manière dont certains titres ou autres instruments sont évalués par le Fonds pour l'application des politiques et restrictions d'investissement peut différer de la manière dont ces investissements sont évalués par d'autres types d'investisseurs.

La conclusion de tels contrats implique, à différents degrés, des éléments de risques de taux d'intérêt, de crédit, de marché et de documents supérieurs aux montants déclarés dans le Bilan. De tels risques impliquent le risque potentiel d'absence de marché liquide pour ces contrats, le risque que la contrepartie aux contrats manque à son obligation ou soit en désaccord avec la signification des dispositions contractuelles des contrats et le risque que les taux d'intérêt évoluent de manière défavorable.

Pour un Fonds, le risque maximum de perte lié au risque de crédit de la contrepartie est la valeur nette actualisée des flux de trésorerie à recevoir de la contrepartie pour la durée de vie restante du contrat, dans la mesure où le montant est positif. Le risque est limité par un accord général de compensation entre le Fonds et la contrepartie et par une garantie auprès d'un Fonds pour couvrir l'exposition du Fonds à la contrepartie.

Contrats de swap de corrélation Certains Fonds peuvent investir dans des contrats de swap de corrélation pour acquérir ou atténuer leur exposition aux titres de référence sous-jacents. Les contrats de swap de corrélation impliquent que deux parties conviennent d'échanger des flux de trésorerie sur la base de la corrélation évaluée d'un actif sous-jacent précisé. Une partie convient d'échanger un « taux fixe » ou taux d'exercice contre un « taux variable » ou corrélation du prix réalisé de l'actif sous-jacent relatif au montant notionnel. Au moment du lancement, le taux d'exercice est généralement déterminé de telle sorte que la juste valeur du swap soit égale à zéro. À la date d'échéance, un flux de trésorerie net est échangé selon lequel le montant du remboursement est égal à la différence entre la corrélation du prix réalisé de l'actif sous-jacent et le taux d'exercice multiplié par le montant notionnel. En tant que bénéficiaire de la corrélation du prix d'exercice fixé, le Fonds reçoit le montant de remboursement si la corrélation du prix réalisé de l'actif sous-jacent est inférieure au taux d'exercice et verse le montant de remboursement si la corrélation est supérieure au prix d'exercice. En tant que payeur de la corrélation du prix d'exercice fixé, le Fonds doit s'acquitter du montant de remboursement si la corrélation du prix réalisé de l'actif sous-jacent est inférieure au taux d'exercice et reçoit le montant de remboursement si la corrélation est supérieure au prix d'exercice. Ce type de contrat est principalement un contrat à terme sur la corrélation future du prix réalisé de l'actif sous-jacent.

Contrats de swap de défaillance Certains Fonds peuvent utiliser des swaps de défaillance sur émissions d'entreprises, des prêts, des titres souverains, des obligations municipales américaines ou des bons du Trésor américain afin de disposer d'une mesure de protection contre les défaillances des émetteurs (c'est-à-dire pour réduire le risque lorsque le Fonds détient ou est exposé à l'obligation de référence) ou pour prendre une position longue ou courte active par rapport à la probabilité de défaillance d'un émetteur particulier. Les contrats de swap de défaillance impliquent le versement par une partie (appelée l'« acheteur de protection ») d'une série de paiements à une autre partie (le « vendeur de protection ») en l'échange du droit de recevoir un rendement défini dans le cas d'un événement de crédit de l'entité, obligation ou indice de référence, tel qu'indiqué dans le contrat de swap. En tant que vendeur de protection dans le cadre d'un contrat de swap de défaillance, le Fonds perçoit généralement de l'acheteur de protection un revenu à taux fixe tout au long de la durée du swap à condition qu'aucun événement de crédit ne se produise. En tant que vendeur, un Fonds augmente l'endettement de son portefeuille car, en plus du total de son actif net, il sera exposé au montant notionnel du swap.

Si le Fonds est vendeur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) paiera à l'acheteur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et prendra livraison de l'obligation référencée, d'autres obligations livrables ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) paiera un montant de règlement net sous forme de liquidités ou de titres équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé. Si le Fonds est acheteur d'une protection et si un événement de crédit se produit, comme indiqué dans les conditions du contrat de swap donné, le Fonds (i) recevra de la part du vendeur de la protection un montant équivalent au montant notionnel du swap et remettra l'obligation référencée, d'autres obligations livrables ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé, ou (ii) recevra un montant de règlement net sous forme de liquidités ou de titres équivalents au montant notionnel du swap, moins la valeur de recouvrement de l'obligation référencée ou des titres sous-jacents qui composent l'indice référencé. Les teneurs de marché estiment les valeurs de recouvrement selon les taux standard du secteur ou les facteurs et considérations spécifiques à une entité jusqu'à ce que survienne un événement de crédit. Lorsque survient un événement de crédit, la valeur de recouvrement est déterminée par une enchère dans laquelle on utilise un nombre minimum de demandes de courtiers conjugué à une méthode particulière de valorisation, pour calculer la valeur du règlement. La possibilité de livrer d'autres obligations peut déclencher l'option de livraison au moindre coût (le droit de l'acheteur de protection à livrer l'obligation dont la valeur est la plus basse après la survenance de l'événement de crédit).

Les contrats de swap de défaillance sur des émissions d'entreprises ou des titres souverains impliquent le versement par une partie d'une série de paiements au bénéfice d'une autre partie en échange du droit de recevoir un rendement défini en cas de défaillance ou d'un autre événement de crédit. Lorsque survient un événement de crédit et qu'un règlement en numéraire n'est pas choisi, il est possible de livrer diverses autres obligations à la place de l'obligation de référence. La possibilité de livrer d'autres obligations peut déclencher l'option de livraison au moindre coût (le droit de l'acheteur de protection à livrer l'obligation dont la valeur est la plus basse après la survenance de l'événement de crédit).

Les contrats de swap de défaillance sur les indices de crédit impliquent le versement par une partie d'une série de paiements au bénéfice d'une autre partie en l'échange du droit de recevoir un rendement défini dans le cas d'une dévaluation, d'une insuffisance de principal, d'une insuffisance d'intérêts ou d'une défaillance de tout ou partie des entités de référence composant l'indice de crédit. Un indice de crédit est un panier d'instruments de ou d'expositions au crédit jugés représentatifs d'une partie du marché du crédit dans son ensemble. Ces indices sont composés de crédits de référence qui sont évalués par un groupe de négociateurs comme étant les entités les plus liquides sur le marché des swaps de défaillance pour le secteur de l'indice. Les composantes des indices peuvent comprendre, notamment, des titres de qualité « investment grade », des titres à rendement élevé, des titres adossés à des actifs, des marchés émergents, et/ou différentes notations de crédit au sein de chaque secteur. Les indices de crédit sont négociés en utilisant des swaps de défaillance avec des conditions normalisées y compris un écart fixe et des dates d'échéance standard. Un swap de défaillance sur indice référence tous les titres dans l'indice, et en cas de défaillance, les événements de crédit sont réglés en fonction de la pondération de ce nom au sein de l'indice. La composition des indices change de manière périodique, généralement tous les semestres, et pour la plupart des indices, chaque titre possède une pondération équivalente au sein de l'indice. Le Fonds peut utiliser des swaps de défaillance sur des indices de crédit afin de couvrir un portefeuille de swaps de défaillance ou d'obligations moins cher que s'il devait acheter de nombreux swaps de défaillance pour obtenir un effet similaire. Les swaps de défaillance sur des indices de crédit constituent des instruments pour protéger les investisseurs qui détiennent des obligations contre les défaillances et les négociateurs les utilisent pour spéculer sur les variations de la qualité de crédit.

Les écarts de crédit implicites utilisés pour calculer la juste valeur de contrats de swap de défaillance sur émissions d'entreprises, prêts, émissions souveraines, émissions municipales américaines ou du Trésor américain en fin d'exercice le cas échéant, représentés en termes absolus, figurent dans le Tableau des investissements. Ils servent d'indicateur de la situation actuelle du risque de paiement/exécution et représentent la probabilité ou le risque de défaillance de l'entité référencée.

L'écart de crédit implicite d'une entité référencée donnée reflète le coût de l'achat/la vente de la protection et peut comprendre des paiements d'avance requis pour pouvoir conclure le contrat. Le creusement d'un écart de crédit signale une détérioration du crédit de l'entité référencée et une plus grande probabilité ou un risque accru de défaillance ou d'autres événements de crédit tel que défini dans le contrat. Dans le cas des contrats de swap de défaillance sur titres adossés à des actifs et indices de crédit, les cours de marché cotés et les valeurs qui en résultent constituent l'indicateur de la situation actuelle du risque de paiement/de performance. L'augmentation des justes valeurs en termes absolus par rapport au montant notionnel du swap, représente une détérioration du crédit de l'entité référencée et une plus grande probabilité ou un risque accru de défaillance ou d'autres événements de crédit comme défini dans le contrat.

Le montant maximum des paiements futurs (sans décotes) qu'un Fonds pourrait être amené à effectuer en tant que vendeur/acheteur de protection au titre d'un contrat de swap de défaillance est un montant égal au montant notionnel du contrat. Les montants notionnels de tous les contrats de swap de défaillance en cours au 31 décembre 2022 dans lesquels le Fonds est vendeur/acheteur de protection figurent dans le Tableau des investissements. La valeur de recouvrement des obligations référencées respectives, les paiements d'avance reçus lors de la conclusion des contrats ou les montants nets reçus du règlement des contrats de swap de défaillance pour l'achat de protection conclus par le Fonds pour la (les) même(s) entité(s) référencée(s) pourraient compenser en partie les montants potentiels à verser.

Contrats de swap sur devises croisées Certains Fonds peuvent conclure des contrats de swap sur devises croisées pour acquérir ou atténuer leur exposition au risque de change. Les contrats de swap sur devises croisées impliquent l'échange entre deux parties de deux devises différentes assorti d'un accord pour inverser l'échange à une date ultérieure à des taux de change spécifiques. L'échange de devises à la date de lancement du contrat a lieu au taux au comptant courant. L'échange à l'échéance peut avoir lieu au même taux de change, à un taux spécifique, ou au taux au comptant courant. Les versements d'intérêts, le cas échéant, sont effectués entre les parties en fonction des taux d'intérêt disponibles dans les deux devises à la conclusion du contrat. Les conditions des contrats de swap sur devises croisées peuvent porter sur plusieurs périodes. Les swaps sur devises croisées sont généralement négociés avec les banques commerciales et d'investissement. Certains swaps sur devises croisées peuvent ne pas prévoir d'échange de flux de trésorerie de principal, mais uniquement des échanges de flux de trésorerie d'intérêt. Les opérations de change à la date de lancement seront reflétées séparément sur une base brute avec le montant notionnel du principal en devise au débit ou au crédit, selon le cas pour la partie flottante ou fixe, au Bilan.

En ce qui concerne les catégories couvertes, les plus-values ou moins-values réalisées et latentes sont imputées uniquement aux catégories d'actions correspondantes. Les plus-values ou moins-values latentes figurent dans la rubrique Instruments financiers dérivés du Bilan. Dans le cadre de ces contrats, les titres peuvent être identifiés en tant que garantie conformément aux conditions des contrats respectifs.

Contrats de swap de taux d'intérêt Certains Fonds sont soumis au risque de taux d'intérêt dans le cadre normal de leurs objectifs d'investissements. Pour un Fonds qui détient des obligations à taux fixe, la valeur desdites obligations peut diminuer si les taux d'intérêt augmentent. Un Fonds peut conclure des contrats de swap de taux d'intérêt pour se couvrir contre ce risque et conserver sa capacité à générer des revenus aux taux de marché en vigueur. Les contrats de swap de taux d'intérêt impliquent l'échange par le Fonds avec une autre partie de leurs engagements respectifs à payer ou recevoir un intérêt afférent au montant notionnel du principal. Certaines formes de contrats de swap de taux d'intérêt comprennent : (i) les taux plafond, selon lesquels une partie convient, en échange d'une prime, d'effectuer des paiements à l'autre partie dans la mesure où les taux d'intérêt excèdent un taux défini (le « taux plafond »), (ii) les taux plancher, selon lesquels une partie convient, en échange d'une prime, d'effectuer des paiements à l'autre partie dans la mesure où les taux d'intérêt tombent en deçà d'un taux défini (le « taux plancher »), (iii) les tunnels, selon lesquels une partie vend un taux plafond et achète un taux plancher, ou inversement, en vue de se protéger contre les fluctuations des taux d'intérêt excédant des niveaux minimum et maximum déterminés, (iv) les swaps de taux d'intérêt remboursables par anticipation, selon lesquels l'acheteur paie un montant initial en contrepartie du droit de mettre fin au contrat pour un coût zéro à une date prédéterminée avant la date d'échéance, (v) les swaps à différentiel fixe qui permettent aux utilisateurs de swaps de taux d'intérêt de verrouiller le différentiel (ou écart) futur entre le taux du swap de taux d'intérêt et un indice de référence spécifique, ou (vi) les swaps de base, selon lesquels les deux parties peuvent échanger des taux d'intérêt variables sur la base de différents marchés monétaires.

Contrats de swap de rendement total Certains Fonds peuvent conclure des swaps de rendement total. Les contrats de swap de rendement total sur matières premières impliquent des engagements d'échange de flux de trésorerie basé sur le cours d'une matière première contre un cours ou taux fixe ou flottant. Une partie reçoit des paiements sur la base de la juste valeur de la matière première en question et paie un montant fixe. Les contrats de swap de rendement total sur indices impliquent des engagements à payer des intérêts contre un rendement indexé sur le marché. Une contrepartie paie le rendement total d'un actif de référence particulier, qui peut être une action, un indice ou une obligation, et reçoit en échange une série de paiements réguliers. Si le rendement total du titre ou de l'indice sous-jacent est supérieur ou inférieur à l'obligation de taux d'intérêt de compensation, le Fonds doit verser un paiement à la contrepartie ou recevoir de celle-ci un montant.

Certains Fonds peuvent investir dans des swaps de rendement total sur titres (« swaps sur titres »). Des swaps sur titres peuvent être utilisés dans le but de générer un profit ou pour éviter une perte relative aux fluctuations de la valeur ou du prix de titres ou d'instruments financiers ou d'un indice sur de tels titres ou instruments financiers. Un swap sur titres est un instrument financier dérivé créé dans le but de reproduire la performance économique et les flux de trésorerie d'un investissement classique dans une action.

Les risques inhérents dans les swaps sur titres dépendent de la position dans la transaction prise par un Fonds : en utilisant des swaps sur titres, un Fonds peut prendre une position longue sur la valeur sous-jacente, auquel cas le Fonds profitera d'une augmentation de la valeur de l'action sous-jacente et souffrira d'une diminution de cette valeur. Les risques inhérents à une position longue sont similaires à ceux pris lors de l'achat de l'action sous-jacente. À l'inverse, un Fonds peut prendre une position courte sur l'action sous-jacente, auquel cas le Fonds profitera d'une diminution de la valeur de l'action sous-jacente et souffrira d'une augmentation. Les risques inhérents à une position courte sont plus importants que ceux inhérents à une position longue : tandis qu'il existe un plafond à une perte maximale dans le cas d'une position longue si le titre sous-jacent est évalué à zéro, la perte maximale dans le cas d'une position courte est celle de l'augmentation de la valeur de l'action sous-jacente, une augmentation, en théorie, sans limite.

Il doit être noté que la prise d'une position longue ou courte dans un swap sur titres est fondée sur l'opinion des Conseillers en investissement concernant l'évolution future du titre sous-jacent. La position peut avoir un impact négatif sur la performance du Fonds.

Les contrats de swaps de volatilité sont également appelés contrats de volatilité à terme et swaps de volatilité, et sont des contrats dans lesquels les contreparties conviennent d'effectuer des paiements liés aux variations de la volatilité (c'est-à-dire l'ampleur de la variation sur une période donnée) d'un instrument référencé sous-jacent, tel qu'une devise, un taux, un indice, un titre ou tout autre instrument financier. Les swaps de volatilité permettent aux parties de tenter de couvrir le risque de volatilité et/ou de prendre des positions sur la volatilité future estimée d'un instrument référencé sous-jacent. Par exemple, le Fonds peut conclure un swap de volatilité afin de prendre la position basée sur l'augmentation de la volatilité de l'instrument référencé sur une période donnée. Si la volatilité de l'instrument référencé augmente au cours de la période spécifiée, le Fonds recevra un paiement de sa contrepartie sur la base de la différence entre le niveau de volatilité réalisée de l'instrument concerné et le niveau de volatilité convenu par les parties. Si la volatilité de l'instrument référencé n'augmente pas au cours de la période spécifiée, le Fonds versera un paiement à sa contrepartie sur la base de l'écart entre le niveau de volatilité réalisée de l'instrument concerné et le niveau de volatilité convenu par les parties. À la date d'échéance, un flux de trésorerie net est échangé selon lequel le montant du remboursement est égal à la différence entre la volatilité des cours réalisée de l'instrument référencé et le prix d'exercice multiplié par le montant notionnel. En tant que bénéficiaire de la volatilité du prix réalisée, le Fonds reçoit le montant de remboursement si la volatilité des cours réalisée de l'instrument référencé est supérieure au prix d'exercice et verse le montant de remboursement si la volatilité des cours réalisée est inférieure au prix d'exercice. En tant que payeur de la volatilité du prix réalisée, le Fonds doit s'acquitter du montant de remboursement si la volatilité des cours réalisée de l'instrument référencé est supérieure au prix d'exercice et reçoit le montant de remboursement si la volatilité des cours réalisée est inférieure au prix d'exercice. Les paiements sur un swap de volatilité seront plus importants s'ils sont basés sur le carré mathématique de la volatilité (c'est-à-dire la volatilité mesurée multipliée par elle-même, appelée « variance »). Ce type de swap de volatilité est souvent appelé swap de variance.

7. GESTION DE PORTEFEUILLE EFFICACE

Dans les limites autorisées par les objectifs et politiques d'investissement des Fonds et sous réserve des limites définies périodiquement par la Banque centrale et les dispositions du Prospectus, le recours, à des fins de gestion de portefeuille efficace, aux instruments financiers dérivés et aux techniques d'investissement est possible pour tous les Fonds. Les Fonds peuvent utiliser ces instruments financiers dérivés et ces techniques d'investissement pour assurer une couverture contre les fluctuations des taux d'intérêt, des taux de change des devises non fonctionnelles ou des cours des titres ou dans le cadre de leur stratégie globale d'investissement.

Le total des produits/(frais) des intérêts résultant des Contrats de mise en pension au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022 était de 155 496 772 $/ (296 154 $) (31 décembre 2021 : 1 815 898 $/(4 593 880 $)).

Le total des produits/(frais) des intérêts résultant des Contrats de prise en pension au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022 était de 9 791 008 $/ (45 026 160 $) (31 décembre 2021 : 4 690 120 $/(10 666 937 $)).

Le total des produits/(frais) des intérêts résultant des Transactions par vente et rachat dos-à-dos au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022 était de 950 $/ (6 496 889 $) (31 décembre 2021 : 259 028 $/(225 795 $)).

8. FISCALITÉ

En vertu des lois et pratiques en vigueur, la Société est admissible en tant que société de placement, conformément à la définition visée à l'article 739B de la loi de consolidation fiscale de 1997 (Taxes Consolidation Act), comme amendée, tant qu'elle est résidente en Irlande. De ce fait, elle n'est pas assujettie à l'impôt irlandais sur les bénéfices ou les plus-values. Toutefois, l'impôt irlandais peut s'appliquer à certains « événements imposables ». Un événement imposable comprend tout paiement de distribution aux actionnaires ou un encaissement, un rachat, une annulation, un transfert ou une cession présumée (une cession présumée surviendra à l'expiration d'une Période considérée) d'actions ou l'appropriation ou l'annulation d'actions d'un actionnaire par la Société afin de satisfaire le montant d'impôt à payer sur une plus-value résultant d'un transfert.

Le Fonds n'est redevable d'aucun impôt irlandais au titre d'événements imposables au regard de ce qui suit :

(a) un actionnaire qui n'est ni un Résident irlandais, ni un Résident habituel en Irlande à des fins fiscales au moment de l'événement imposable, à condition que le Fonds soit en possession des déclarations valables appropriées conformément aux dispositions de la loi de consolidation fiscale de 1997 (Taxes Consolidation Act), telle qu'amendée, et que le Fonds ne dispose pas d'informations qui pourraient raisonnablement suggérer que les informations contenues dans le présent document ne sont plus substantiellement exactes, ou que le Fonds ait été autorisé par l'administration fiscale irlandaise à effectuer des paiements bruts en l'absence des déclarations appropriées ;

(b) certains actionnaires résidents exonérés de l'impôt irlandais ayant remis au Fonds les déclarations obligatoires requises et signées ;

(c) toute transaction relative à des actions détenues dans un système de compensation reconnu tel que désigné par ordonnance des autorités fiscales ;

(d) un échange d'actions représentant un compartiment contre un autre compartiment du Fonds ;

(e) un échange d'actions découlant d'une fusion ou d'une restructuration admissible du Fonds avec un autre fonds ; et

(f) certains échanges d'actions entre époux et ex-époux.

En l'absence des déclarations appropriées, le Fonds sera assujetti à l'impôt irlandais si un événement imposable se produit.

Le régime des sociétés de placement stipule que les autorités fiscales peuvent agréer les fonds de placement commercialisés hors d'Irlande à faire des paiements à des actionnaires non-résidents sans déduction de l'impôt irlandais si aucune déclaration pertinente n'existe, sous réserve de satisfaire des « mesures équivalentes ». Un Fonds qui veut recevoir l'agrément doit en faire la demande par écrit aux autorités fiscales, en confirmant le respect des conditions pertinentes.

Les dividendes, intérêts et plus-values (le cas échéant) que la Société reçoit relatifs à ses investissements (autres que les titres d'émetteurs irlandais) peuvent être assujettis à des impôts, y compris des retenues à la source, dans les pays dans lesquels les émetteurs des investissements sont situés. On s'attend à ce que la Société ne soit pas capable de bénéficier des taux réduits de retenues à la source dans le cadre des conventions de double imposition entre l'Irlande et de tels pays. Si cette position change à l'avenir et si l'application de taux plus bas entraîne un remboursement à la Société, la Valeur Nette d'Inventaire ne sera pas réévaluée et le bénéfice sera affecté proportionnellement aux actionnaires existants au moment du remboursement.

Conformément au régime de fonds déclarant introduit par le HM Revenue and Customs du Royaume-Uni, chaque catégorie d'actions sera considérée comme un « fonds offshore » distinct pour les besoins de l'impôt britannique. Le régime de fonds déclarant autorise un fonds offshore à demander un agrément préalable aux autorités fiscales britanniques pour bénéficier du statut de « fonds déclarant ». Lorsqu'un fonds offshore a reçu l'agrément de « fonds déclarant », il maintiendra ce statut tant qu'il continuera à satisfaire les conditions sans avoir à demander une nouvelle certification aux autorités fiscales. Chaque Catégorie d'Actions de la Société est gérée en tant que « fonds déclarant ». Ce traitement a été approuvé par l'administration fiscale britannique (HM Revenue and Customs).

9. POLITIQUE EN MATIÈRE DE DIVIDENDES

Comme stipulé dans le Supplément du Fonds correspondant, la distribution des dividendes peut être déclarée sur ;

(i) le produit net des investissements consistant en intérêts et dividendes ;
(ii) les gains réalisés sur la liquidation d'investissements moins les pertes réalisées et latentes (incluant frais et dépenses). Si les bénéfices réalisés lors de la cession d'investissements minorés des pertes réalisées et latentes sont négatifs, les Fonds peuvent toutefois verser des dividendes à partir du revenu net des investissements et/ou du capital ;
(iii) d'autres fonds (capital compris) susceptibles d'être légalement distribués à partir du Fonds ou de la Catégorie d'Actions du Fonds concerné.

Les frais de gestion et autres frais, ou une partie de ceux-ci, peuvent être imputés au capital et, de ce fait, celui-ci peut s'éroder et les distributions seront réalisées en renonçant à la croissance potentielle du capital. Ce cycle peut se poursuivre jusqu'à épuisement total du capital. Le raisonnement qui préside à l'imputation au capital consiste à maximiser le montant distribuable aux actionnaires.

Dans le cas de la Catégorie de distribution II, les Administrateurs peuvent, à leur gré, payer les commissions à partir du capital et prendre en considération l'écart de rendement entre la Catégorie d'Actions couverte pertinente et la Catégorie d'Actions de base (qui constitue une distribution à partir du capital). L'écart de rendement peut être positif ou négatif et est calculé en prenant en compte la contribution de la couverture de la Catégorie d'Actions découlant des Catégories couvertes.

Dans le cas des Catégories M Détail, les Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, Asia Strategic Interest Bond Fund, Euro Income Bond Fund, Euro Short-Term Fund, Income Fund, Low Duration Income Fund, Mortgage Opportunities Fund et US Short-Term Fund, à l'exception des Catégories G Institutions, G Détail, E de distribution Q, E de distribution II Q et Investisseurs de distribution A (le cas échéant) des Fonds susmentionnés, les distributions de dividendes sont déclarées tous les mois et, au gré de l'actionnaire, payés en espèces ou réinvestis dans d'autres actions chaque mois.

Dans le cas des catégories Administrations du Fonds Diversified Income Fund, des Catégories d'Actions BE Détail, BM Détail, BN Détail, M Détail et N Détail, les distributions de dividendes sont déclarées chaque mois et ces dividendes sont, au gré de l'Actionnaire, payés en espèces ou réinvestis dans d'autres actions chaque mois.

Dans le cas des Catégories G Institutions, G Détail et Investisseurs de distribution A, les distributions de dividendes sont déclarées tous les ans et ces dividendes sont, au gré de l'actionnaire, payés en espèces ou réinvestis dans d'autres actions chaque année.

Pour tous les autres Fonds ayant des Catégories d'Actions de distribution, les dividendes seront déclarés trimestriellement et, au gré de l'actionnaire, payés en espèces ou réinvestis en actions supplémentaires après déclaration.

La distribution de dividendes aux porteurs de parts rachetables figure au poste Frais financiers du Compte de résultat. Les produits ou les plus-values affecté(e)s aux Actions de capitalisation ne seront ni déclarées ni distribuées, mais la VNI par action des Actions de capitalisation sera augmentée pour tenir compte de ces produits ou plus-values.

Les distributions de dividendes non réinvestis dans des Actions sont versées aux actionnaires par virement bancaire. Toute distribution de dividende non réclamée à l'issue d'un délai de six ans à compter de la date de déclaration de ladite distribution est perdue par défaut et reversée sur le compte du Fonds concerné. Les Actionnaires peuvent choisir de réinvestir leurs distributions de dividendes dans d'autres actions ou de percevoir leurs distributions de dividendes en espèces en cochant la case correspondante sur le Formulaire de demande.

Une partie des distributions de dividendes figurant dans le Compte de résultat a été payée sur le capital des Fonds ci-dessous (montants en milliers) ;

Fonds	Exercice clos le 31 déc. 2022	Exercice clos le 31 déc. 2021
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	$ 30	$ 0
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	1	0
Fonds Diversified Income Fund	5 609	0
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	524	605
Fonds Dynamic Bond Fund	237	0
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	€ 4 339	€ 6 563
Fonds Global Bond Fund	$ 824	$ 0
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	2 887	3 365
Fonds Global High Yield Bond Fund	124	0
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	0	15
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	131	51
Fonds Global Real Return Fund	805	0
Fonds Income Fund	3 564	1 310
Fonds Low Average Duration Fund	19	0
Fonds Low Duration Opportunities Fund	644	0
Fonds Total Return Bond Fund	104	0
Fonds UK Corporate Bond Fund	£ 247	£ 0
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	69	29

10. RÉTROCESSION DE COMMISSIONS

La Société ou son Conseiller en investissement peut effectuer des opérations pour le compte des Fonds avec ou par le biais de l'agence de courtiers exécutifs, qui peut, outre l'exécution d'ordres ordinaires, de temps à autre, fournir ou veiller à ce que soient fournis à la Société ou ses représentants des biens, services ou autres bénéfices tels que des services de recherche et conseils. La Société ou son Conseiller en investissement peuvent payer à ces courtiers des commissions de courtage dont une partie peut être affectée à la fourniture de biens ou services autorisés. Ces Conseillers en investissement qui sont des sociétés d'investissement relevant de la Directive sur les marchés d'instruments financiers (« MiFID ») ou soumis à des dispositions réglementaires équivalentes paieront sur leurs propres ressources pour toute recherche effectuée par des tiers qu'ils ont commanditée en relation avec la gestion des actifs de chaque Fonds.

11. RESPONSABILITÉ SÉPARÉE

La Société est une société d'investissement à capital variable à compartiments multiples et responsabilité séparée entre les compartiments. En conséquence, tout passif au nom d'un Fonds de la Société ou qui lui est attribuable doit être acquitté uniquement sur les actifs de ce Fonds, et ni la Société ni ses Administrateurs, ses administrateurs judiciaires, auditeurs, liquidateurs, liquidateurs provisoires ni toute autre personne ne doivent appliquer, ou être obligés d'appliquer, les actifs dudit Fonds afin de s'acquitter d'un passif encouru au nom d'un autre Fonds de la Société ou qui lui est attribuable, indépendamment de la date à laquelle ledit passif a été encouru.

12. MODIFICATIONS DU PROSPECTUS, DE L'ACTE CONSTITUTIF ET DES STATUTS

Le 7 février 2022, le Prospectus et les Suppléments de la Société ont été mis à jour conformément à la création des Catégories d'Actions back-end, à savoir les catégories « BE Détail », « BN Détail » et « BM Détail » (les « Catégories d'Actions back-end ») dans le Fonds Diversified Income Fund, le Fonds Dynamic Multi-Asset Fund, le Fonds Emerging Markets Bond Fund, le Fonds Global High Yield Bond Fund et le Fonds StocksPLUS™ Fund. En outre, il n'y aura pas de commission de souscription pour les Catégories d'Actions en GBP au titre de chaque Fonds et la période d'amortissement pour le Fonds PIMCO Climate Bond Fund, le Fonds PIMCO ESG Income Fund et le Fonds Income Fund II a été prolongée d'un an à trois ans.

Le 13 avril 2022, le Prospectus a été mis à jour pour ajouter une définition des « Titres à revenu fixe ESG » à la section ESG qui décrit ce qui constitue une obligation verte, une obligation sociale, une obligation durable et une obligation liée à la durabilité. À la même date, le Supplément du Fonds PIMCO Climate Bond Fund a été mis à jour conjointement à la description des « Titres à revenu fixe ESG » afin de préciser que le Fonds peut également investir dans n'importe quel autre type de Titres à revenu fixe ESG, y compris ceux du secteur des combustibles fossiles. Pour plus de détails, veuillez consulter le Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers dans l'annexe non révisée. À la même date, les Suppléments des Fonds UK Sterling Long Average Duration Fund, US Small Cap StocksPLUS™ Fund, PIMCO RAE PLUS Emerging Markets Fund et PIMCO RAE PLUS Global Developed Fund ont été retirés du Prospectus suite à leur révocation officielle par la Banque centrale.

Le 13 avril 2022, le Supplément du Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund a été mis à jour en ce qui concerne la divulgation de l'abandon de commission révisée, le Supplément du Fonds Inflation Multi-Asset Fund a été modifié pour refléter le changement de nom du Fonds, qui passe de « Fonds Inflation Strategy Fund » à « Fonds Inflation Multi-Asset Fund » et le Supplément a également été mis à jour pour modifier l'indice de référence utilisé par le Fonds et pour refléter la réduction des frais de gestion unifiés facturés par le Fonds pour les différentes catégories d'actions. Les informations concernant les investissements du Fonds en titres de capital ou titres liés à des actions ont également été modifiées. Le Supplément du Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund a été modifié pour refléter la réduction des frais de gestion facturés par le Fonds. À cet égard, les frais de gestion des Catégories E, M Détail, G Détail et T ont tous été réduits de 31 points de base et les frais de gestion facturés au titre de la Catégorie R ont été réduits de 17 points de base.

Le 22 avril 2022, les Suppléments pour le Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund et le Fonds Euro Short-Term Fund ont été mis à jour pour refléter une modification de la définition du « Jour de négociation » pour les Fonds qui passe de « chaque jour où les banques sont ouvertes à Munich, Allemagne... » à « chaque jour où les banques sont ouvertes en Angleterre... », suite au déménagement de certains gestionnaires de portefeuille de PIMCO Europe GmbH de Munich à sa succursale de Londres.

Le 1er juin 2022, le Supplément du Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund a été mis à jour pour inclure un abandon de commission de 0,30 % à appliquer aux frais de gestion pour toutes les Catégories d'Actions du Fonds (à l'exception de la Catégorie d'Actions Z) à compter du 1er juin 2022 et qui seront ensuite réduits à 0,15 % le 1er juin 2023 et prendront totalement fin le 1er juin 2024.

Le 8 juin 2022, les Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund, Diversified Income ESG Fund et Emerging local Bond ESG Fund ont été approuvés par la Banque centrale et les Suppléments de ces Fonds ont été incorporés au Prospectus consolidé.

Le 13 juin 2022, les Suppléments des Fonds PIMCO ESG Income Fund, Global Bond ESG Fund, Emerging Markets Bond ESG Fund et Global Investment Grade Credit ESG Fund ont été mis à jour conformément aux exigences de classification de l'article 8 du SFDR et pour indiquer clairement que les Fonds doivent promouvoir des caractéristiques environnementales et sociales dans le cadre de leur approche d'investissement durable (à noter que, bien que l'investissement durable continue de faire partie de l'objectif des Fonds, des « investissements durables » ne feront pas partie de leur objectif d'investissement respectif). Les Fonds continueront à investir dans des investissements durables, à appliquer un filtrage environnemental et social par exclusion et à dialoguer avec les émetteurs concernant leurs pratiques ESG. Pour plus de détails, veuillez consulter le Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers dans l'annexe non révisée.

Le 1er juillet 2022, le Supplément du Fonds Euro Credit Fund a été mis à jour en ce qui concerne la divulgation relative à l'abandon de commission révisée. À la même date, le Supplément du Fonds Global LIBOR Plus Bond Fund a été mis à jour pour refléter le changement du nom du Fonds pour celui de Fonds Low Duration Opportunities Fund et pour modifier l'indice de référence utilisé par le Fonds. À la même date, les Suppléments des Fonds PIMCO Capital Securities Fund, Low Duration Opportunities ESG Fund, PIMCO Credit Opportunities Bond Fund, Dynamic Bond Fund, Mortgage Opportunities Fund et PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund ont été mis à jour pour modifier l'indice de référence utilisé par les Fonds.

Le 22 juillet 2022, les Suppléments des Fonds Euro Short Term Fund, Global Real Return Fund et Global Low Duration Real Return Fund ont été mis à jour pour indiquer explicitement qu'ils vont promouvoir des caractéristiques environnementales en appliquant des critères ESG contraignants à la sélection des actifs sous-jacents parallèlement aux stratégies d'investissement actuelles des Fonds. Les Fonds sont classés comme Fonds relevant de l'article 8 au sens du SFDR. À la même date, le Supplément relatif à la promotion des caractéristiques environnementales de la Société a été mis à jour afin d'améliorer encore la divulgation sur la stratégie d'exclusion et le dialogue avec les émetteurs.

En outre, la divulgation précise que les investissements alignés sur la taxinomie seront de 0 %.

Pour plus de détails, veuillez consulter le Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers dans l'annexe non révisée.

Le 29 juillet 2022, le Supplément du Fonds Strategic Income Fund a été mis à jour pour modifier l'indice de référence utilisé par le Fonds, pour refléter la stratégie exclusive modifiée en matière de revenu du capital utilisée par le Fonds, pour refléter l'annulation du contrat de Research Affiliates, LLC et Parametric Portfolio Associates, LLC, pour refléter le seuil modifié d'investissement dans d'autres investissements générateurs de revenus, pour refléter la modification des investissements exclus de la limite d'investissement dans des marchés émergents du Fonds et également pour refléter une réduction des frais de gestion facturés au titre des catégories d'actions du Fonds.

Le 8 août 2022, le Prospectus a été mis à jour en ce qui concerne les modifications apportées aux divulgations relatives au LIBOR, à la section fiscalité, aux mandats des Administrateurs, aux délais de règlement pour la réception des montants de souscription sur certaines catégories d'actions et la création d'un nouveau type de catégorie d'actions, la Catégorie F, dans les Suppléments des Fonds pour les Fonds Income Fund II et Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund, dont les Suppléments ont également été mis à jour à la même date en conséquence.

Le 30 septembre 2022, les Suppléments des Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund et PIMCO Asia High Yield Bond Fund ont été mis à jour pour modifier l'heure limite de réception des ordres des Fonds de 9 h 00 heure irlandaise chaque Jour de négociation à 10 h 00 heure irlandaise chaque Jour de négociation.

Le 30 novembre 2022, le Prospectus et les Suppléments concernés de la Société ont été mis à jour conformément au Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (« Règlement SFDR ») et la Banque centrale a notifié qu'une Annexe précontractuelle pour chaque supplément du Fonds relevant de l'Article 8 et l'Article 9 devait leur être ajoutée. À la même date, le supplément relatif à la Promotion des caractéristiques environnementales et toutes les références à ce supplément ont été supprimés dans l'ensemble du Prospectus. Les informations relatives à l'alignement avec le Règlement sur la taxinomie figurant dans chaque supplément du Fonds relevant de l'Article 8 et l'Article 9 ont également été supprimées. À la même date, le Prospectus a été mis à jour avec la publication sur le site Internet des Principales incidences négatives. Pour plus de détails, veuillez consulter le Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers dans l'annexe non révisée.

L'Acte constitutif et les Statuts de la Société ont été modifiés au cours de l'exercice le 15 septembre 2022.

13. COMMISSIONS ET FRAIS

(a) Commissions payables au Gestionnaire

À l'exception des Actions BN Détail, BM Détail et BE Détail tel qu'indiqué dans le Supplément du Fonds concerné, la Commission unifiée ne dépassera pas 2,50 % par an de la VNI de chaque Fonds.

(b) Frais de gestion

Le Gestionnaire, pour chaque Fonds et comme décrit dans le Prospectus, fournit des services de conseil en investissement, d'administration, de dépositaire et autres, en contrepartie desquels chaque Fonds lui verse des Frais de gestion uniques. Les Frais de gestion (telle que définie dans le Prospectus) pour chacun des Fonds s'accumule à chaque Jour de négociation (tel que défini dans le Supplément du Fonds concerné) et est exigible chaque mois à terme échu. Le Gestionnaire peut verser tout ou partie des Frais de gestion aux Conseillers en investissement au titre des conseils en investissement et autres services fournis par ceux-ci et pour que les Conseillers en investissement paient les services d'administration, de garde et autres fournis aux Fonds par le Gestionnaire.

Les Frais de gestion de chaque catégorie de chaque Fonds (exprimés en pourcentage annuel de sa VNI) sont les suivants :

	Catégories Institutions, G Institutions, Investisseurs, Administrations (%)	Catégorie H Institutions (%)	BE Détail BM Détail BN Détail Catégorie E, G Détail, M Détail, N Détail, Catégorie T (%)	Catégorie R (%)	Catégorie W (%)
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	0,65	0,82	1,55	S/O	S/O
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	0,65	S/O	1,50	S/O	S/O
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	0,79	S/O	1,69	0,93	S/O
Fonds PIMCO Climate Bond Fund[1]	0,52	S/O	1,42	S/O	S/O
Fonds Commodity Real Return Fund	0,74	0,91	1,64	S/O	S/O
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	0,90	S/O	1,80	S/O	S/O
Fonds Diversified Income Fund	0,69	0,86	1,59	S/O	0,55
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	0,69	S/O	1,59	S/O	S/O
Fonds Diversified Income ESG Fund	0,72	S/O	1,62	S/O	S/O
Fonds Dynamic Bond Fund	0,90	1,07	1,80	0,99	S/O
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	0,85	1,02	1,85	S/O	S/O
Fonds Emerging Local Bond Fund	0,89	1,06	1,89	S/O	S/O
Fonds Emerging local Bond ESG Fund	0,92	S/O	1,92	S/O	S/O
Fonds Emerging Markets Bond Fund	0,79	0,96	1,69	S/O	S/O
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	0,89	S/O	1,74	S/O	S/O
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	0,95	S/O	1,85	S/O	S/O
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund[2]	0,65	S/O	1,55	S/O	S/O
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	0,85	S/O	1,75	S/O	S/O
Fonds PIMCO ESG Income Fund	0,59	S/O	1,49	0,82	S/O
Fonds Euro Bond Fund	0,46	S/O	1,36	S/O	S/O
Fonds Euro Credit Fund[3]	0,46	0,38	1,36	S/O	S/O
Fonds Euro Income Bond Fund	0,49	S/O	1,39	S/O	S/O
Fonds Euro Long Average Duration Fund	0,46	S/O	S/O	S/O	S/O
Fonds Euro Short-Term Fund[4]	0,29	S/O	1,04	S/O	S/O
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	0,55	S/O	1,45	S/O	S/O
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund[5]	0,32	0,49	0,82	S/O	S/O
Fonds Global Advantage Fund	0,70	S/O	1,70	S/O	S/O
Fonds Global Bond Fund	0,49	0,66	1,39	0,76	0,39
Fonds Global Bond ESG Fund	0,52	S/O	1,42	S/O	S/O
Fonds Global Bond Ex-US Fund	0,49	0,66	1,39	S/O	S/O
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	0,95	1,12	2,15	S/O	S/O
Fonds Global High Yield Bond Fund	0,55	0,72	1,45	0,80	S/O
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	0,49	0,66	1,39	0,76	0,39
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	0,52	S/O	1,42	S/O	S/O
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	0,49	S/O	1,39	S/O	S/O
Fonds Global Real Return Fund	0,49	0,66	1,39	0,76	S/O
Fonds Income Fund	0,55	0,72	1,45	0,80	S/O
Fonds Income Fund II[6]	0,55	S/O	1,45	S/O	S/O
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	0,79	0,96	1,69	S/O	S/O
Fonds Low Average Duration Fund	0,46	0,63	1,36	0,75	S/O
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	0,49	S/O	1,39	S/O	S/O
Fonds Low Duration Income Fund[7]	0,55	0,72	1,45	S/O	S/O

	Catégories Institutions, G Institutions, Investisseurs, Administrations (%)	Catégorie H Institutions (%)	BE Détail BM Détail BN Détail Catégorie E, G Détail, M Détail, N Détail, Catégorie T (%)	Catégorie R (%)	Catégorie W (%)
Fonds Low Duration Opportunities Fund	0,49	S/O	1,20	S/O	S/O
Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund	0,52	S/O	S/O	S/O	S/O
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	0,99	S/O	1,89	S/O	S/O
Fonds Mortgage Opportunities Fund	0,69	0,86	1,59	S/O	S/O
Fonds StocksPLUS™ Fund	0,55	0,72	1,45	S/O	S/O
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	0,69	S/O	S/O	S/O	S/O
Fonds Strategic Income Fund	0,79	S/O	1,69	S/O	S/O
Fonds Total Return Bond Fund	0,50	0,67	1,40	0,77	S/O
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	1,40	1,57	2,50	S/O	S/O
Fonds UK Corporate Bond Fund	0,46	S/O	S/O	S/O	S/O
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	0,46	S/O	S/O	S/O	S/O
Fonds US High Yield Bond Fund	0,55	0,72	1,45	0,80	S/O
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	0,49	0,66	1,39	S/O	S/O
Fonds US Short-Term Fund[8]	0,45	0,62	0,85	S/O	S/O

(1) Ce chiffre prend en compte un abandon de commission par le Gestionnaire à hauteur de 0,05 % pour la Catégorie Investisseurs du 31 mai 2021 au 31 mai 2023. Cet abandon de commission expirera à compter du 1er juin 2023.

(2) Pour toutes les Catégories, le chiffre prend en compte un abandon de commission par le Gestionnaire au taux de 0,30 % par an. L'abandon de commission sera réduit à 0,15 % le 1er juin 2023. L'abandon de commission prendra fin le 1er juin 2024 et pourrait rester en vigueur jusqu'à ce que le Gestionnaire, sur préavis écrit aux actionnaires du Fonds, décide de mettre fin ou de cesser d'appliquer cette commission ou d'en réduire la portée pour toute période ultérieure.

(3) Le taux de la Catégorie H Institutions prend en compte un abandon de commission par le Gestionnaire à hauteur de 0,25 % par an. L'abandon de commission se prolongera jusqu'au 30 juin 2023 et prendra fin le 1er juillet 2023.

(4) Les taux de la Catégorie Institutions et de la Catégorie E prennent en compte un abandon de commission par le Gestionnaire à un taux de 0,11 % par an à partir du 31 mai 2021. Cet abandon de commission expirera à compter du 19 janvier 2024.

(5) Les taux des Catégories Institutions et H Institutions prennent en compte un abandon de commission par le Gestionnaire de 0,14 % par an. Le taux de la Catégorie E tient compte d'un abandon de commission par le Gestionnaire au taux de 0,54 % par an. L'abandon de commissions expirera à compter du 18 janvier 2024.

(6) Pour toutes les Catégories, le chiffre prend en compte un abandon de commission par le Gestionnaire au taux de 0,04 % par an. L'abandon de commission a pris fin le 1er janvier 2023.

(7) Pour toutes les Catégories, le chiffre prend en compte un abandon de commission par le Gestionnaire au taux de 0,05 % par an. L'abandon de commission pour toutes les catégories a été prolongé jusqu'au 31 décembre 2022 et a pris fin le 1er janvier 2023.

(8) Les taux indiqués pour les Catégories E, G Détail et M Détail prennent en compte un abandon de commission par le Gestionnaire au taux de 0,30 % par an. Les abandons de commissions resteront en vigueur au moins jusqu'à ce que le Gestionnaire, sur préavis écrit aux actionnaires du Fonds, décide de mettre fin ou de cesser d'appliquer cet abandon de commission ou d'en réduire la portée pour toute période ultérieure.

Les Fonds Diversified Income ESG Fund, Emerging Local Bond Fund ESG Fund et Low Duration Opportunities ESG Fund ont été lancés au cours de l'exercice.

Les Frais de gestion de tous les Fonds (à l'exception des Fonds Inflation Multi-Asset Fund, PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund et Strategic Income Fund) étaient inchangés depuis le 31 décembre 2021, à l'exception des modifications de l'abandon de commission indiquées ci-dessus.

Les Frais de gestion imputables aux Catégories H Institutions, BE Détail, BM Détail, BN Détail, E, G Détail, M Détail, N Détail et T sont généralement supérieurs à ceux imputables aux autres catégories d'actions. Sur cette commission plus élevée, le Gestionnaire peut payer les frais de distribution, d'intermédiaires et autres services rendus aux Actionnaires dans ces catégories d'actions des Fonds, directement ou indirectement par les distributeurs, courtiers-négociants, banques, intermédiaires financiers ou autres intermédiaires. Compte tenu de la nature fixe des Frais de gestion, le Gestionnaire, et non les actionnaires, prend le risque de toute augmentation du prix des services couverts par lesdits Frais de gestion. Il prend également le risque de la hausse des niveaux de frais afférents à ces services au-delà des Frais de gestion du fait de la diminution des actifs nets. À l'inverse, le Gestionnaire, et non les actionnaires, profitera de la baisse du prix des services couverts par lesdits Frais de gestion. Il profitera également de la baisse des niveaux de frais afférents à ces services, en pourcentages des actifs nets, du fait de la hausse des actifs nets.

En raison de la nature spécifique des Actions de Catégorie Z, le Compte de résultat ne comporte pas de Frais de gestion (la Catégorie Z est essentiellement offerte aux autres Fonds de la Société ou à des fins d'investissement direct par des investisseurs institutionnels qui ont conclu un accord de gestion ou tout autre contrat avec les Conseillers en investissement ou toute autre société affiliée de PIMCO) et, afin d'éviter la duplication des frais, les Frais de gestion de la Catégorie Z est fixée à 0,00 % par an.

(c) Services de conseil en investissement

Le Gestionnaire fournit et/ou aide à la prestation de services de conseil en investissement pour le compte de la Société. Ces services couvrent l'investissement et le réinvestissement des actifs de chacun des Fonds. Les commissions des Conseillers en investissement (TVA comprise, s'il y a lieu) sont payées par le Gestionnaire sur les Frais de gestion.

(d) Services d'administration, de garde et autres services

Le Gestionnaire fournit et/ou aide à la fourniture de services d'administration, de garde et autres pour le compte de la Société. Ces services comprennent les services administratifs, de mandat de transfert, de comptabilité des Fonds, de garde et de garde par délégation pour chaque Fonds. Les commissions et frais de l'Agent administratif et du Dépositaire (TVA comprise, s'il y a lieu) sont payés par le Gestionnaire sur les Frais de gestion ou par les Conseillers en investissement.

Le Gestionnaire fournit et/ou aide à la fourniture d'autres services pour le compte de la Société. Ils peuvent comprendre les services de cotation par un courtier, les services de paiement et autres représentants locaux, la comptabilité, l'audit, les services juridiques et autres services professionnels, les services de secrétariat de la Société, d'impression, de publication et de traduction, et la fourniture et la coordination de certains services de supervision, administration et destinés aux actionnaires nécessaires aux activités des Fonds. Les commissions et frais ordinaires afférents à ces services (TVA comprise, s'il y a lieu) sont payés par le Gestionnaire, ou les Conseillers en investissement pour le compte du Gestionnaire, sur les Frais de gestion.

Les Fonds supporteront d'autres frais liés à leur fonctionnement qui ne sont pas couverts par les Frais de gestion et qui peuvent varier et influer sur le niveau total de frais des Fonds dont, sans y être limité, les impôts et taxes gouvernementales, les frais de courtage, les commissions et autres frais de transaction (y compris, mais sans s'y limiter, les frais et dépenses liés à la vérification préalable des investissements et des investissements potentiels et/ou aux négociations de ces transactions), les coûts d'emprunt d'argent, dont les frais d'intérêts, les frais d'établissement, les dépenses exceptionnelles (comme les frais de litiges et les indemnisations) et les jetons de présence et frais des Administrateurs indépendants de la Société et de leur conseiller.

La Société a versé des jetons de présence aux Administrateurs indépendants à hauteur de 180 000 € pour l'exercice clos le 31 décembre 2022 (31 décembre 2021 : 180 000 €). De plus, chaque Administrateur indépendant est remboursé de ses débours raisonnables. Les Administrateurs non indépendants ne sont pas habilités à percevoir une rémunération distincte pour leur mandat d'administrateur des Fonds. Les honoraires des Administrateurs sont comptabilisés en « Autres charges » dans le Compte de résultat.

Le tableau ci-après présente les frais qui ont été facturés à la Société par les commissaires aux comptes pendant les exercices clos le 31 décembre 2022 et le 31 décembre 2021. Les frais indiqués dans le tableau ci-dessous sont hors TVA.

Honoraires des Commissaires aux comptes	31 décembre 2022	31 décembre 2021
Audit des états financiers de l'entité	€ 636 152	€ 567 652
Autres services d'assurance	0	0
Services de conseils fiscaux	0	0
Autres services hors audit	0	0

Frais de services Les Frais de services, qui s'appliquent aux Catégories Investisseurs, sont payés uniquement au Gestionnaire et peuvent servir à rembourser les courtiers-négociants, les intermédiaires financiers ou autres intermédiaires fournissant des services afférents à la distribution et à la commercialisation d'Actions et/ou à la prestation de certains services aux actionnaires ou à l'administration de plans ou de programmes pour lesquels les Actions des Fonds sont des sources de financement, et à rembourser d'autres frais liés (tels que définis dans le Supplément du Fonds concerné). Ces services sont fournis directement par le Gestionnaire ou indirectement par des courtiers-négociants, des intermédiaires financiers ou autres intermédiaires à l'attention de tous les actionnaires des Catégories Investisseurs.

Les mêmes services s'appliquent à tous les actionnaires des Catégories Investisseurs qui supportent les frais. Ces services peuvent inclure : répondre aux questions des actionnaires concernant les Fonds et leur performance, aider les actionnaires pour l'achat, le rachat et l'échange d'Actions ; maintenir des informations sur les comptes personnels et fournir des relevés de comptes aux actionnaires ; et conserver d'autres archives importantes pour l'investissement d'un actionnaire dans les Fonds.

Les plans ou programmes qui utilisent des Actions de Fonds comme source de financement peuvent inclure des produits d'assurance à capital variable et des régimes de pension, de retraite ou d'épargne gérés par les employeurs. Tous les actionnaires des Catégories Investisseurs bénéficient de ces services en vertu de contrats conclus avec les intermédiaires financiers qui entretiennent avec ces actionnaires des relations de prestataires de services. Les Frais de services sont calculés sur la base de 0,35 % par an de la VNI de chaque Fonds imputable aux Catégories Investisseurs. Les Frais de services sont restés inchangés depuis le 31 décembre 2021. Ils sont payés sur la VNI imputable aux Catégories Investisseurs de la VNI de ces Fonds. Les Frais de services pour chacun des Fonds s'accumulent chaque Jour de négociation et sont exigibles chaque mois à terme échu. Le Gestionnaire peut conserver pour son compte la totalité ou une partie des Frais de services qui ne sont pas dus aux courtiers-négociants, aux intermédiaires financiers ou à d'autres intermédiaires.

Frais de commercialisation Les Frais de commercialisation, qui s'appliquent aux Catégories Administrations, sont payés au Distributeur au titre des services personnels qu'il rend aux actionnaires des Fonds et de la tenue des comptes des actionnaires. Cela comprend les rémunérations et les frais afférents (frais téléphoniques et frais généraux compris) dus aux consultants financiers ou autres salariés de courtiers partenaires ou remisiers, à certaines banques et à d'autres intermédiaires financiers qui participent au traitement des demandes d'achat ou de rachat ou au traitement des versements de dividendes, qui fournissent des informations régulières aux actionnaires montrant leurs positions dans les Actions d'un Fonds, qui communiquent les informations de la Société aux actionnaires, qui donnent des conseils réguliers sur la pertinence d'investissements spécifiques proposés par les Fonds en fonction des besoins des actionnaires, qui répondent aux demandes de renseignement des actionnaires sur ces services ou qui forment du personnel pour la prestation de ces services.

Ces services sont fournis directement par le Distributeur ou indirectement par des courtiers-négociants, des banques, des intermédiaires financiers ou autres intermédiaires à l'attention de tous les actionnaires des Catégories Administrations. Les Frais de commercialisation sont calculés sur une base de 0,50 % par an de la VNI de chaque Fonds, à l'exception du Fonds StocksPLUS™ Fund pour lequel ils sont calculés sur une base de 0,75 % par an, attribuable aux Catégories Administrations. Les Frais de commercialisation de chacun des Fonds s'accumulent chaque Jour de négociation et sont payables chaque mois à terme échu. Le Distributeur peut conserver pour son compte la totalité ou une partie des Frais de commercialisation qui ne sont pas à verser aux courtiers-négociants, aux banques, aux intermédiaires financiers ou à d'autres intermédiaires.

Les Frais de commercialisation sont restés inchangés depuis le 31 décembre 2021.

(e) Frais de distribution
Les Frais de distribution qui s'appliquent aux Actions de Catégories T, BN Détail, BM Détail et BE Détail sont versés au Distributeur au titre de services rendus aux actionnaires des Fonds.

Ces services sont fournis directement par le Distributeur ou indirectement par des courtiers-négociants, des banques, des intermédiaires financiers ou autres intermédiaires à l'attention de tous les actionnaires de la Catégorie T. Les Frais de distribution sont calculés sur la base de 0,40 % par an de la VNI de chaque Fonds imputable à la Catégorie d'Actions T, à l'exception des Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, PIMCO Credit Opportunities Bond Fund, Dynamic Bond Fund, Euro Bond Fund, Global Bond Fund, Global Bond ESG Fund, Global Bond Ex-US Fund, Global Low Duration Real Return Fund, Global Real Return Fund, Low Duration Opportunities Fund, PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund et Total Return Bond Fund qui supportent des Frais de distribution de 0,30 % par an de la VNI de ces Fonds imputables à la Catégorie d'Actions T.

Concernant les Catégories d'Actions BE Détail, BM Détail et BN Détail uniquement, lorsque c'est indiqué dans le Supplément concerné, les Frais de distribution peuvent atteindre 1 % par an de la VNI et par conséquent la Commission unifiée peut dépasser 2,50 % de la VNI.

Les Frais de distribution pour chacun des Fonds s'accumulent chaque Jour de négociation et sont exigibles chaque mois à terme échu. Le Distributeur peut conserver pour son compte la totalité ou une partie des Frais de distribution qui ne sont pas à verser aux courtiers-négociants, aux banques, aux intermédiaires financiers ou à d'autres intermédiaires.

(f) Limitation des dépenses (incluant la Renonciation et la Récupération des Frais de gestion)
Le Gestionnaire a convenu avec la Société, conformément au Contrat de gestion conclu entre la Société et le Gestionnaire le 28 janvier 1998, tel que modifié, de gérer le total annuel des charges d'exploitation de toute Catégorie d'un Fonds, en renonçant à, réduisant ou remboursant tout ou partie de ses Frais de gestion, dans la mesure où (et pour une durée où) ces charges d'exploitation seraient supérieures, en raison du paiement de frais de constitution et de la part proportionnelle des jetons de présence des Administrateurs, à la somme des Frais de gestion de cette Catégorie de ce Fonds (avant application de l'abandon des Frais de gestion applicable), des Frais de services ou de commercialisation, le cas échéant, et autres frais supportés par cette Catégorie d'actions du Fonds non couverts par les Frais de gestion tel que décrit ci-dessus (autres que les frais de constitution et la part proportionnelle des jetons de présence des Administrateurs) plus 0,0049 % par an (calculés quotidiennement sur la VNI du Fonds).

Au cours d'un mois où le Contrat de gestion est en vigueur, le Gestionnaire peut récupérer sur un Fonds toute partie des Frais de gestion abandonnés, réduits ou remboursés conformément au Contrat de gestion (le « Montant de remboursement ») au cours des 36 mois précédents, sous réserve que ce montant payé au Gestionnaire 1) n'excédera pas 0,0049 % par an des actifs nets moyens de la Catégorie du Fonds (calculés quotidiennement) ; 2) n'excédera pas le Montant de remboursement total ; 3) ne comportera aucun montant déjà remboursé au Gestionnaire ; ou 4) n'aura pas pour effet de maintenir une Catégorie d'un Fonds à un rendement négatif net.

Les Frais de gestion qui figurent dans le Compte de résultat sont enregistrés bruts de l'abandon des Frais de gestion concernés le cas échéant. Les abandons de Frais de gestion sont enregistrés à la rubrique Remboursement effectué par les Conseillers en investissement du Compte de résultat. Les Frais de gestion sont versés au Gestionnaire nets de l'abandon.

14. TRANSACTIONS AVEC DES PARTIES LIÉES

Le Gestionnaire, les Conseillers en investissement, les Distributeurs et les Administrateurs sont des parties liées. Les honoraires dus à ces parties sont détaillés dans la Note 13, le cas échéant.

Au 31 décembre 2022, le Gestionnaire détenait 1 786 291 (31 décembre 2021 : 2 203 631) actions du Fonds US Short-Term Fund.

Chacun des Fonds peut investir dans les autres Fonds de la Société et/ou dans d'autres organismes de placement collectif gérés par le Conseiller en investissement ou des entités affiliées au Conseiller en investissement (« Fonds affiliés »).

Les Fonds suivants détenaient des investissements croisés pendant les exercices clos le 31 décembre 2022 et 31 décembre 2021. Ces investissements croisés ont été éliminés aux fins de présentation du total des Fonds de la Société.

	31 décembre 2022
Fonds	Investissements croisés
Fonds Diversified Income Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds Diversified Income Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Diversified Income Fund	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Diversified Income Fund	Fonds US Short-Term Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds US Short-Term Fund
Fonds Dynamic Bond Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds Dynamic Bond Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Dynamic Bond Fund	Fonds US Short-Term Fund
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	Fonds PIMCO Capital Securities Fund
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	Fonds Income Fund
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund
Fonds Emerging Local Bond Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Emerging Local Bond Fund	Fonds Emerging local Bond ESG Fund

Fonds	31 décembre 2022 Investissements croisés
Fonds Emerging Local Bond Fund	Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Fonds Emerging Markets Bond Fund	Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Fonds Euro Income Bond Fund	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Global Bond Fund	Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund
Fonds Global Bond Fund	Fonds Global Bond Ex-US Fund
Fonds Global Bond Fund	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Global Bond Fund	Fonds UK Corporate Bond Fund
Fonds Global Bond Fund	Fonds US Short-Term Fund
Fonds Global Bond ESG Fund	Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund
Fonds Global High Yield Bond Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds Global High Yield Bond Fund	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Low Average Duration Fund	Fonds US Short-Term Fund
Fonds Low Duration Opportunities Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds Low Duration Opportunities Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Total Return Bond Fund	Fonds US Short-Term Fund
Fonds US High Yield Bond Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund

Fonds	31 décembre 2021 Investissements croisés
Fonds Diversified Income Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds Diversified Income Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Diversified Income Fund	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Diversified Income Fund	Fonds US Short-Term Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Fonds US Short-Term Fund
Fonds Dynamic Bond Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds Dynamic Bond Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Dynamic Bond Fund	Fonds US Short-Term Fund
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	Fonds PIMCO Capital Securities Fund
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	Fonds Income Fund
Fonds Emerging Local Bond Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds Emerging Local Bond Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Emerging Markets Bond Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds Emerging Markets Bond Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Euro Income Bond Fund	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Euro Income Bond Fund	Fonds US Short-Term Fund
Fonds Global Bond Fund	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Global Bond Fund	Fonds Global Bond Ex-US Fund
Fonds Global Bond Fund	Fonds UK Corporate Bond Fund
Fonds Global Bond Fund	Fonds US Short-Term Fund
Fonds Global Bond ESG Fund	Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Fonds Mortgage Opportunities Fund
Fonds Global High Yield Bond Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds Global High Yield Bond Fund	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund
Fonds Low Average Duration Fund	Fonds US Short-Term Fund
Fonds Low Duration Opportunities Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds Low Duration Opportunities Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund
Fonds Total Return Bond Fund	Fonds US Short-Term Fund
Fonds US High Yield Bond Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund

Certains Fonds investissent dans la Catégorie Z du Fonds PIMCO China Bond Fund, un Fonds de PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. et du Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund, un Fonds de PIMCO Select Funds plc, qui sont considérés comme des Fonds affiliés. Du fait de la nature de la Catégorie Z et dans le but d'éviter le doublement des frais, les Frais de gestion de la Catégorie Z des deux fonds sont fixés à 0,00 % par an.

Certains Fonds investissent dans les Fonds de PIMCO ETFs plc : Fonds PIMCO Euro Short-Term High Yield Corporate Bond Index UCITS ETF, Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF, Fonds PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF et Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF, qui sont considérés comme des Fonds affiliés. Étant donné que ces Fonds n'offrent pas de catégorie d'actions à commission nulle, les Frais de gestion sont payés par le Fonds investissant et le Fonds affilié sous-jacent. En conséquence, un Abandon de frais de conseil en investissement est déduit avant paiement par le Fonds investissant au Gestionnaire et comptabilisé à la rubrique Remboursement effectué par les Conseillers en investissement du Compte de résultat.

Au cours des exercices clos les 31 décembre 2022 et 31 décembre 2021, les Fonds ci-dessous ont participé à l'achat et à la vente de titres parmi les Fonds affiliés, à l'achat et à la vente de placements croisés et à l'achat et à la vente d'investissements dans des Fonds affiliés (montants en milliers) :

	31 décembre 2022	
Fonds	Achats	Ventes
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	$ 908 623	$ 895 972
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	129 084	124 231
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	190 635	542 608
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	449	22 179
Fonds Commodity Real Return Fund	85 291	5 900
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	5 183	8 342
Fonds Diversified Income Fund	638 902	1 645 597
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	75 129	141 980
Fonds Diversified Income ESG Fund	200	200
Fonds Dynamic Bond Fund	441 881	264 103
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	104 045	26 348
Fonds Emerging Local Bond Fund	1 837 395	1 892 204
Fonds Emerging Markets Bond Fund	1 462 642	1 981 418
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	210 705	83 931
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	92 941	88 297
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	119 731	128 393
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	1 000	1 438
Fonds Euro Bond Fund	265 381	223 907
Fonds Euro Credit Fund	80 580	117 241
Fonds Euro Income Bond Fund	254 310	373 646
Fonds Euro Long Average Duration Fund	19 622	16 672
Fonds Euro Short-Term Fund	71 651	76 393
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	12 406	8 873
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	39 660	47 565
Fonds Global Advantage Fund	153 288	145 735
Fonds Global Bond Fund	1 056 550	1 129 083
Fonds Global Bond ESG Fund	9 751	15 801
Fonds Global Bond Ex-US Fund	641 210	604 043
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	680 984	811 602
Fonds Global High Yield Bond Fund	727 445	1 125 258
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	3 785 028	4 629 158
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	87 522	194 414
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	232 291	226 698
Fonds Global Real Return Fund	837 486	812 145
Fonds Income Fund	1 603 346	2 928 690
Fonds Income Fund II	15 740	16 700
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	87 463	56 410
Fonds Low Average Duration Fund	552 743	550 289
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	359 824	340 371
Fonds Low Duration Income Fund	181 275	178 894
Fonds Low Duration Opportunities Fund	491 198	704 279
Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund	100	100
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	21 008	18 700

Fonds	31 décembre 2022 Achats	31 décembre 2022 Ventes
Fonds Mortgage Opportunities Fund	$ 1 108 810	$ 1 242 395
Fonds StocksPLUS™ Fund	150 012	544 833
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	410	600
Fonds Strategic Income Fund	339 690	329 066
Fonds Total Return Bond Fund	447 487	642 290
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	116 658	79 650
Fonds UK Corporate Bond Fund	12 034	18 983
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	33 666	11 074
Fonds US High Yield Bond Fund	909 401	1 318 576
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	344 028	348 295
Fonds US Short-Term Fund	498 555	563 279

Fonds	31 décembre 2021 Achats	31 décembre 2021 Ventes
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	$ 930 487	$ 627 852
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	165 995	157 516
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	842 578	1 282 906
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	12 181	36 255
Fonds Commodity Real Return Fund	85 802	2 857
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	48 254	56 216
Fonds Diversified Income Fund	709 844	846 494
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	162 297	194 020
Fonds Dynamic Bond Fund	685 201	652 706
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	68 805	0
Fonds Emerging Local Bond Fund	2 803 551	3 028 245
Fonds Emerging Markets Bond Fund	2 226 141	2 506 979
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	400 193	195 636
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	125 375	117 717
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	146 141	149 062
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	5 796	5 138
Fonds PIMCO ESG Income Fund	38 088	37 501
Fonds Euro Bond Fund	409 047	675 330
Fonds Euro Credit Fund	244 089	268 477
Fonds Euro Income Bond Fund	289 126	338 915
Fonds Euro Long Average Duration Fund	9 199	18 917
Fonds Euro Short-Term Fund	130 792	29 055
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	0	10 407
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	78 910	54 093
Fonds Global Advantage Fund	133 329	132 261
Fonds Global Bond Fund	1 872 859	1 915 889
Fonds Global Bond ESG Fund	31 687	59 669
Fonds Global Bond Ex-US Fund	321 477	316 136
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	558 323	413 432
Fonds Global High Yield Bond Fund	1 747 596	1 870 595
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	6 186 283	9 924 519
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	147 939	108 832
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	220 996	234 412
Fonds Global Real Return Fund	545 874	423 198
Fonds Income Fund	15 696 715	15 975 225
Fonds Income Fund II	7 602	4 900
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	83 666	70 300
Fonds Low Average Duration Fund	246 591	234 632
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	267 013	155 242
Fonds Low Duration Income Fund	338 363	223 065
Fonds Low Duration Opportunities Fund	1 085 237	858 876
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	44 210	35 000
Fonds Mortgage Opportunities Fund	2 344 185	2 305 270
Fonds StocksPLUS™ Fund	205 747	165 929
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	701	400
Fonds Strategic Income Fund	350 865	387 451
Fonds Total Return Bond Fund	872 762	1 201 072
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	30 407	29 700
Fonds UK Corporate Bond Fund	13 283	261 176
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	$ 9 780	$ 31 686
Fonds US High Yield Bond Fund	1 675 695	1 761 476

Fonds	31 décembre 2021 Achats	31 décembre 2021 Ventes
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	248 414	288 579
Fonds US Short-Term Fund	74 780	775 389

Le tableau ci-après présente la valeur des actions en circulation détenues par le groupe Allianz, les Fonds de la Société, les Fonds affiliés à la Société et les employés des Conseillers en investissement, parties liées de la Société, au-delà de 20 % de l'Actif net du Fonds, au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021.

Fonds	31 décembre 2022 % Détenu	31 décembre 2021 % Détenu
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	21,53	S/O
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	49,24	55,13
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	23,94	S/O
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	21,78	S/O
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	25,65	25,07
Fonds Diversified Income ESG Fund	100,00	S/O
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	25,10	S/O
Fonds Emerging local Bond ESG Fund	100,00	S/O
Fonds Emerging Markets Bond Fund	22,87	34,74
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	57,57	S/O
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	26,22	22,84
Fonds Euro Credit Fund	30,16	20,77
Fonds Euro Income Bond Fund	21,29	26,26
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	98,78	95,52
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	31,55	S/O
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	65,44	34,62
Fonds Income Fund II	40,67	91,35
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	29,48	S/O
Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund	100,00	S/O
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	50,65	S/O
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	84,86	94,07
Fonds Strategic Income Fund	47,13	S/O
Fonds US Short-Term Fund	31,95	38,70

Les Fonds dont les actionnaires, à l'exception du Groupe Allianz, des Fonds de la Société, des Fonds affiliés à la Société et des employés des Conseillers en investissement, détiennent plus de 20 % de l'actif net du Fonds, sont indiqués séparément à la Note 16.

Au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022, le Fonds Income Fund a vendu des titres pour un montant de 136 931 USD (31 décembre 2021 : 0 USD) à Repack Bond Collateral Ltd. (l'« Entité »), une société à responsabilité limitée exemptée en vertu des lois des Îles Caïmans, qui est une partie liée du Conseiller en investissement. Aucune commission ne sera versée aux Conseillers en investissement par l'Entité. Au 31 décembre 2022, le Fonds Income Fund détenait 9 694 Billets (31 décembre 2021 : 9 694 Billets) de BNP Paribas Issuance BV., qui est garanti par des billets émis par l'Entité. Au cours de l'exercice, l'Entité a versé au Fonds Income Fund des distributions totales pour un montant de 43 624 USD (31 décembre 2021 : 32 746 USD) et des tirages pour 0 USD (31 décembre 2021 : 260 225 USD).

Intérêts des Administrateurs et du Secrétaire en actions et contrats

Au 31 décembre 2022, V. Mangala Ananthanarayanan détenait 8 187,77 (31 décembre 2021 : 8 187,77) actions du Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 5 319,15 (31 décembre 2021 : néant) actions du Fonds PIMCO Capital Securities Fund, 8 757,87 (31 décembre 2021 : 8 757,87) actions du Fonds Dynamic Multi-Asset Fund, 3 619,69 (31 décembre 2021 : néant) actions du Fonds Global Bond Fund et 27 543,65 (31 décembre 2021 : 22 028,26) actions du Fonds Income Fund, tous des Fonds de la Société.

Au 31 décembre 2022, Ryan P. Blute détenait 5 387,93 (31 décembre 2021 : 5 387,93) actions du Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 24 131,27 (31 décembre 2021 : 24 131,27) actions du Fonds Low Average Duration Fund et 82 494,63 (31 décembre 2021 : 72 957,20) actions du Fonds Low Duration Income Fund, tous des Fonds de la Société.

Au 31 décembre 2022, Craig A. Dawson détenait 18 118,23 (31 décembre 2021 : 18 118,23) actions du Fonds PIMCO Capital Securities Fund, 97 370,98 (31 décembre 2021 : 97 370,98) actions du Fonds Low Duration Income Fund et 92 850,51 (31 décembre 2021 : 92 850,51) actions du Fonds Low Duration Opportunities Fund, tous des Fonds de la Société.

Au 31 décembre 2022, David M. Kennedy détenait 4 449,56 (31 décembre 2021 : 4 729,05) actions du Fonds Emerging Markets Bond Fund et 16 786,79 (31 décembre 2021 : 16 786,79) actions du Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund, tous deux Fonds de la Société.

Aucun autre Administrateur ne détenait d'actions de la Société au cours des exercices clos les 31 décembre 2022 et 31 décembre 2021.

Le Secrétaire ne détenait pas d'actions de la Société au cours des exercices clos les 31 décembre 2022 et 31 décembre 2021.

La Société n'avait aucun employé au cours des exercices clos le 31 décembre 2022 ou le 31 décembre 2021.

15. TAUX DE CHANGE

Aux fins de la consolidation des états financiers, pour parvenir aux chiffres de la Société (requis en vertu de la loi irlandaise sur les sociétés), les montants figurant au Bilan ont été convertis au taux de change en vigueur au 31 décembre 2022 de l'euro au dollar américain (USD/EUR : 0,93699) (31 décembre 2021 : USD/EUR : 0,87935) et de la livre sterling britannique au dollar américain (USD/GBP :0,83132) (31 décembre 2021 : USD/GBP : 0,73831). Les montants du Compte de résultat et de l'État de l'évolution des actifs nets ont été convertis au taux de change moyen pour l'exercice clos le 31 décembre 2022, de l'euro au dollar américain (USD/EUR : 0,95111) (31 décembre 2021 : USD/EUR : 0,84577) et de la livre sterling britannique au dollar américain (USD/GBP :0,81159) (31 décembre 2021 : USD/GBP : 0,72716).

Le tableau suivant reflète les taux de change utilisés pour convertir la livre sterling, l'euro et le dollar américain, les devises fonctionnelles des Fonds de la Société, les investissements et autres actifs et passifs libellés dans des devises autres que la devise fonctionnelle de chaque Fonds.

Les taux de change du peso argentin (« ARS ») au 31 décembre 2022 comprennent une décote de 83 % (31 décembre 2021 : 96 %), en raison d'un écart entre les taux de change officiels de l'Argentine et les taux de change non officiels.

Devise étrangère	31 décembre 2022 Devise de présentation EUR	GBP	USD
AED	S/O	S/O	3,67265
ARS	346,74937	S/O	324,90000
AUD	1,57377	1,77380	1,47460
BRL	5,63481	S/O	5,27975
CAD	1,44607	1,62987	1,35495
CHF	0,98742	S/O	0,92520
CLP	909,24323	S/O	851,95000
CNH	7,38414	8,32269	6,91885
CNY	7,41920	8,36220	6,95170
COP	5 174,97022	S/O	4 848,88500
CZK	24,15399	S/O	22,63200
DKK	7,43643	8,38163	6,96785
DOP	S/O	S/O	56,22000
EGP	S/O	S/O	24,75500
EUR (ou €)	1,00000	1,12710	0,93699
GBP (ou £)	0,88723	1,00000	0,83132
GHS	S/O	S/O	10,20000
HKD	8,32983	S/O	7,80495
HUF	400,44985	S/O	375,21670
IDR	16 614,40701	S/O	15 567,50000
ILS	3,76579	S/O	3,52850
INR	88,29355	S/O	82,73000
JPY (ou ¥)	140,81824	158,71670	131,94500
KES	S/O	S/O	123,40000
KRW	1 349,53703	S/O	1 264,50000
KZT	S/O	S/O	462,72000
MXN	20,79776	23,44122	19,48725
MYR	S/O	S/O	4,40500
NGN	S/O	S/O	460,75000
NOK	10,51348	11,84977	9,85100
NZD	1,68748	1,90197	1,58115
PEN	4,06996	S/O	3,81350
PHP	S/O	S/O	55,72750
PLN	4,68122	S/O	4,38625
RON	S/O	S/O	4,63605
RSD	S/O	S/O	109,92500
RUB	77,90922	S/O	73,00000
SEK	11,12021	12,53362	10,41950
SGD	1,43140	1,61333	1,34120
THB	S/O	S/O	34,63500
TRY	19,97838	22,51769	18,71950
TWD	32,80245	S/O	30,73550
UGX	S/O	S/O	3 720,00000
USD (ou $)	1,06725	1,20290	1,00000
UYU	S/O	S/O	39,76500
VND	S/O	S/O	23 575,00000
ZAR	18,15925	S/O	17,01500
ZMW	S/O	S/O	18,07500

Devise étrangère	31 décembre 2021 Devise de présentation EUR	GBP	USD
AED	S/O	S/O	3,67305
ARS	228,82733	S/O	201,22000
AUD	1,56413	1,86294	1,37542
BRL	6,33420	S/O	5,57000
CAD	1,43645	1,71087	1,26315
CHF	1,03616	S/O	0,91115
CLP	968,89418	S/O	852,00000
CNH	7,23151	8,61302	6,35905
CNY	7,24777	S/O	6,37335
COP	4 628,40293	S/O	4 070,00000
CZK	24,84997	S/O	21,85190
DKK	7,43757	8,85844	6,54025
DOP	S/O	S/O	57,26000
EGP	S/O	S/O	15,71000
EUR (ou €)	1,00000	1,19104	0,87935
GBP (ou £)	0,83960	1,00000	0,73831
GHS	S/O	S/O	6,17500
HKD	8,86595	S/O	7,79630
HUF	368,56496	S/O	324,09870
IDR	16 207,93925	S/O	14 252,50000
ILS	3,53942	S/O	3,11240
INR	84,53448	S/O	74,33565
JPY (ou ¥)	130,95424	155,97170	115,15500
KRW	1 351,84619	S/O	1 188,75000
KZT	S/O	S/O	434,80500
MXN	23,27279	27,71882	20,46500
MYR	S/O	S/O	4,16600
NGN	S/O	S/O	413,75000
NOK	10,02817	11,94395	8,81830
NZD	1,66099	S/O	1,46060
PEN	4,53828	S/O	3,99075
PHP	S/O	S/O	50,99250
PLN	4,58337	S/O	4,03040
RON	S/O	S/O	4,35170
RSD	S/O	S/O	103,39000
RUB	85,29709	S/O	75,00625
SEK	10,29604	12,26299	9,05385
SGD	1,53312	1,82600	1,34815
THB	S/O	S/O	33,40500
TRY	15,10173	17,98676	13,27975
TWD	31,46291	S/O	27,66700
UAH	S/O	S/O	27,28250

Devise étrangère	31 décembre 2021 Devise de présentation EUR	GBP	USD
UGX	S/O	S/O	3 545,00000
USD (ou $)	1,13720	1,35445	1,00000
UYU	S/O	S/O	44,70000
VND	S/O	S/O	22 790,00000
ZAR	18,14971	S/O	15,96000
ZMW	S/O	S/O	16,66810

16. RISQUES FINANCIERS

Les principaux risques relatifs aux instruments financiers de la Société sont le risque de marché, le risque de change, le risque de taux d'intérêt, le risque de liquidité, le risque de crédit et le risque de contrepartie.

(a) Risque de marché

Le risque de marché découle essentiellement des incertitudes relatives aux cours futurs des instruments financiers détenus. Il représente la perte potentielle que chaque Fonds pourrait subir en détenant des positions de marché face à des fluctuations de cours défavorables. Les Conseillers en investissement tiennent compte de la répartition des actifs du portefeuille afin de minimiser le risque inhérent à certains pays ou secteurs d'activité, tout en poursuivant les objectifs d'investissement des Fonds.

Les Conseillers en investissement font appel à un certain nombre de techniques quantitatives pour évaluer l'impact des risques de marché, y compris les événements de crédit, les fluctuations des taux d'intérêt, les écarts de crédit et les valeurs de recouvrement sur le portefeuille d'investissement des Fonds.

Les Conseillers en investissement appliquent l'analyse de la Valeur à risque, (« VaR »), technique largement utilisée par les institutions financières afin de quantifier, évaluer et communiquer les risques de marché. La Valeur à risque est un cadre statistique qui soutient la quantification du risque de marché au sein d'un portefeuille à un intervalle de confiance particulier sur une période de détention définie. Certains Fonds peuvent utiliser le modèle de la VaR relative ou de la VaR absolue. S'ils utilisent le modèle de la VaR relative, la VaR du portefeuille du Fonds ne doit pas dépasser le double de la VaR d'un portefeuille comparable ou d'un portefeuille de référence (un portefeuille similaire ne comportant pas d'instruments financiers dérivés) reflétant le style d'investissement recherché par le Fonds. S'ils utilisent le modèle de la VaR absolue, la VaR du portefeuille du Fonds ne peut dépasser 20 % de la Valeur Nette d'Inventaire du Fonds et la période de détention doit être de 20 jours et la durée des données historiques ne doit pas être inférieure à un an. La Valeur à risque cherche à quantifier les pertes minimums, maximums et moyennes anticipées en dollars qui peuvent résulter du comportement interactif de tous les prix de marchés importants, des écarts, des volatilités, des taux et d'autres risques, y compris le risque de change, le risque de taux d'intérêt, le risque lié aux marchés émergents et le risque de convexité, fondés sur les relations historiques observées entre ces marchés.

Bien que le recours aux instruments financiers dérivés puisse créer une exposition supplémentaire à l'effet de levier, toute exposition de la sorte sera couverte et gérée, en matière de risque, par la méthode de la Valeur à risque, conformément aux prescriptions de la Banque centrale d'Irlande. Les Conseillers en investissement surveillent le risque de portefeuille en utilisant des expositions aux facteurs de marché sur une base journalière. Le risque de marché potentiel est calculé en utilisant l'approche paramétrique delta-normale et la modélisation de facteurs. La Valeur à risque est calculée et transmise automatiquement chaque jour en utilisant les prix de clôture et les informations sur le marché des derniers jours ouvrables. En fonction de l'application des statistiques de risque, différents niveaux de confiance (tel que 99 %) et d'horizons temporels (semaines ou mois) peuvent être sélectionnés.

Des tests de résistance sont également menés mensuellement concernant le modèle de la VaR sur chaque Fonds. Le Groupe de gestion des risques de PIMCO supervise la composition des tests de résistance et effectue les ajustements nécessaires lorsque les conditions de marché ou les compositions de fonds le requièrent. Les tests de résistance évaluent les gains ou pertes potentiels dérivant de chocs sur les variables financières notamment les taux souverains nominaux, les taux de swap nominaux, les taux réels, les écarts de crédit, les évaluations boursières, les valeurs des matières premières, les taux de change, et les volatilités implicites. Outre les tests de résistance mensuels, trois tests de résistance supplémentaires sont également menés, certains sont utilisés quotidiennement et certains sont utilisés à des fins d'analyse de façon interactive. Les premiers sont des tests de duration qui évaluent les répercussions sur la valeur d'un portefeuille si des mouvements non anticipés dans les rendements se produisent sur le marché. Ces durations sont calculées chaque jour ouvrable. Le deuxième test implique une base de données de scénarios historiques de crises qui peuvent être exécutés pour tester les réactions aux tests de ces crises. Les scénarios de crise historique contiennent des changements inattendus des conditions de marché et des matrices de corrélations. Le troisième test consiste en des matrices de corrélation qui peuvent être modifiées manuellement afin de refléter les conditions qui peuvent avoir lieu à l'avenir mais qui ne sont pas encore produites.

Les calculs sont généralement effectués à l'aide de méthodologies de simulation automatisées. Cependant, il existe également des méthodologies afin de vérifier manuellement quels changements dans les matrices de corrélation auraient un important impact négatif sur les portefeuilles. Ces changements de corrélations peuvent ensuite être analysés et des événements réels possibles pouvant provoquer de tels changements peuvent être attribués.

Bien entendu, il ne peut être exclu que les résultats économiques réels diffèrent considérablement des scénarios manuels et automatisés.

Les mesures quotidiennes de la VaR constituent une estimation de la perte du portefeuille sur le mois suivant qui ne serait pas supérieure à 99 % de la période, par rapport aux hypothèses du modèle de la VaR.

La Valeur à risque ne couvre pas tous les risques auxquels le portefeuille peut être exposé. Plus particulièrement, le cadre ne vise pas à inclure le risque de liquidité, le risque de contrepartie ou les incidents de crédit extrêmes, tels que la défaillance d'un émetteur. En pratique, les résultats actuels des transactions diffèreront de la Valeur à risque et peuvent ne pas fournir une indication correcte des gains et pertes dans des conditions de marché tendues. Afin de déterminer la fiabilité des modèles de Valeur à risque, les résultats réels sont surveillés afin de tester la validité des hypothèses et des paramètres utilisés dans le calcul de la Valeur à risque. Les positions de risque de marché sont également soumises à des tests de résistance réguliers afin de s'assurer que le Fonds puisse supporter un événement de marché extrême.

Les tableaux suivants présentent les VaR minimums, maximums, moyennes et de fin d'exercice de chaque Fonds aux 31 décembre 2022 et 31 décembre 2021 :

Fonds	Méthodologie	Indice de référence	31 décembre 2022 Min	Max	Moyenne	Fin d'exercice
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Relative	Indice JPMorgan JACI Non-Investment Grade Index	86,03 %	109,37 %	96,86 %	88,69 %
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	Relative	Indice JPMorgan Asia Credit Index	91,44 %	106,49 %	99,71 %	94,95 %
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	Absolue	S/O	4,38 %	11,46 %	8,28 %	8,49 %
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	Absolue	S/O	2,13 %	4,93 %	3,81 %	4,03 %
Fonds Commodity Real Return Fund	Relative	Indice Bloomberg Commodity Index Total Return	100,90 %	112,80 %	105,31 %	108,93 %
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Absolue	S/O	2,06 %	5,50 %	3,99 %	4,51 %
Fonds Diversified Income Fund	Relative	1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets (couvert en USD), ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index (couvert en USD) et JPMorgan EMBI Global (couvert en USD)	96,68 %	132,63 %	110,21 %	98,82 %
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Absolue	S/O	5,07 %	9,35 %	7,23 %	5,76 %
Fonds Diversified Income ESG Fund	Relative	1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex-Emerging Markets, ICE BofAML BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained ESG Tilt Index et JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index Global Diversified	101,85 %	109,31 %	104,88 %	102,63 %
Fonds Dynamic Bond Fund	Absolue	S/O	2,61 %	5,75 %	4,52 %	4,17 %
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	Absolue	S/O	3,85 %	7,74 %	5,08 %	5,84 %

Fonds	Méthodologie	Indice de référence	31 décembre 2022 Min	Max	Moyenne	Fin d'exercice
Fonds Emerging Local Bond Fund	Relative	Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert)	94,06 %	106,90 %	102,72 %	102,61 %
Fonds Emerging local Bond ESG Fund	Relative	Indice JPMorgan ESG Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index	92,69 %	108,54 %	97,67 %	99,38 %
Fonds Emerging Markets Bond Fund	Relative	Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	97,07 %	110,86 %	104,27 %	102,74 %
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	Relative	Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified	98,21 %	112,18 %	105,42 %	100,17 %
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	Relative	Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	94,77 %	125,73 %	109,89 %	98,72 %
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Relative	50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index/50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en USD)	35,81 %	87,96 %	56,92 %	55,69 %
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Relative	Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert)	84,87 %	113,34 %	104,07 %	109,06 %
Fonds PIMCO ESG Income Fund	Absolue	S/O	1,77 %	4,63 %	3,24 %	3,81 %
Fonds Euro Bond Fund	Relative	Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	91,45 %	107,79 %	101,40 %	102,69 %
Fonds Euro Credit Fund	Relative	Indice Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index	102,32 %	122,65 %	110,14 %	104,97 %
Fonds Euro Income Bond Fund	Absolue	S/O	2,86 %	7,88 %	5,99 %	5,55 %
Fonds Euro Long Average Duration Fund	Relative	Indice Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index	94,30 %	102,20 %	99,42 %	100,39 %
Fonds Euro Short-Term Fund	Absolue	S/O	0,66 %	2,13 %	1,56 %	1,43 %
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	Relative	Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	90,65 %	106,11 %	99,81 %	101,48 %
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Absolue	S/O	2,42 %	4,11 %	3,18 %	3,32 %
Fonds Global Advantage Fund	Relative	Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (clôture de la Bourse de Londres)	98,46 %	115,01 %	106,86 %	102,35 %
Fonds Global Bond Fund	Relative	Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD)	86,07 %	112,02 %	101,52 %	102,14 %
Fonds Global Bond ESG Fund	Relative	Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD)	86,26 %	111,08 %	101,39 %	101,93 %
Fonds Global Bond Ex-US Fund	Relative	Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en USD)	82,61 %	114,31 %	102,72 %	103,34 %
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Relative	60 % de l'Indice MSCI All Country World Index/40 % de l'Indice Bloomberg Global Aggregate USD Hedged	90,26 %	127,43 %	103,81 %	93,05 %
Fonds Global High Yield Bond Fund	Relative	Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en USD	96,87 %	122,97 %	105,69 %	100,40 %
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	Relative	Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD)	97,59 %	116,74 %	105,84 %	101,83 %
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	Relative	Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD)	97,83 %	113,48 %	105,86 %	101,23 %
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	Relative	Indice Bloomberg World Government inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en USD)	89,75 %	119,66 %	104,44 %	110,21 %
Fonds Global Real Return Fund	Relative	Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en USD)	92,16 %	107,84 %	100,44 %	103,88 %
Fonds Income Fund	Absolue	S/O	3,83 %	8,45 %	6,51 %	7,34 %
Fonds Income Fund II	Absolue	S/O	1,92 %	5,97 %	4,25 %	5,62 %
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	Absolue	S/O	6,06 %	9,75 %	7,46 %	8,71 %
Fonds Low Average Duration Fund	Absolue	S/O	1,57 %	3,31 %	2,68 %	3,00 %
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Relative	Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en USD)	82,83 %	112,84 %	101,24 %	102,69 %
Fonds Low Duration Income Fund	Absolue	S/O	2,98 %	6,99 %	5,29 %	5,80 %
Fonds Low Duration Opportunities Fund	Absolue	S/O	1,82 %	5,47 %	3,70 %	3,23 %
Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund	Absolue	S/O	0,96 %	2,14 %	1,77 %	1,76 %
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Relative	Indice Alerian MLP Index	92,23 %	109,76 %	102,35 %	108,22 %
Fonds Mortgage Opportunities Fund	Absolue	S/O	2,75 %	8,49 %	6,19 %	6,01 %
Fonds StocksPLUS™ Fund	Relative	Indice S&P 500 Index (net de la retenue à la source des dividendes)	97,48 %	106,40 %	101,95 %	101,54 %
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Relative	Indice S&P 500 Index (net de la retenue à la source des dividendes)	101,28 %	112,10 %	107,00 %	107,82 %
Fonds Strategic Income Fund	Relative	75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index/25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index	106,90 %	144,99 %	119,86 %	125,90 %
Fonds Total Return Bond Fund	Relative	Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index	95,33 %	113,77 %	103,98 %	100,51 %
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Absolue	S/O	1,91 %	11,57 %	6,10 %	2,57 %
Fonds UK Corporate Bond Fund	Relative	Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	97,22 %	110,46 %	104,62 %	105,19 %
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	Relative	Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index	95,87 %	110,22 %	100,56 %	102,14 %
Fonds US High Yield Bond Fund	Relative	Indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index	96,48 %	122,58 %	104,73 %	100,25 %

Notes relatives aux États financiers (suite)

Fonds	Méthodologie	Indice de référence	31 décembre 2022 Min	Max	Moyenne	Fin d'exercice
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	Relative	Indice Bloomberg U.S. Credit Index	94,56 %	112,79 %	102,51 %	95,83 %
Fonds US Short-Term Fund	Absolue	S/O	0,67 %	1,58 %	1,13 %	1,08 %

Fonds	Méthodologie	Indice de référence	31 décembre 2021 Min	Max	Moyenne	Fin d'exercice
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Relative	Indice J.P. Morgan JACI Non-Investment Grade Index	91,93 %	109,27 %	100,96 %	94,51 %
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	Relative	Indice J.P. Morgan Asia Credit Index	82,05 %	121,37 %	109,16 %	96,23 %
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	Absolue	S/O	3,97 %	7,53 %	4,96 %	4,48 %
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	Absolue	S/O	1,70 %	2,47 %	2,13 %	2,26 %
Fonds Commodity Real Return Fund	Relative	Indice Bloomberg Commodity Index Total Return	96,26 %	117,60 %	106,74 %	104,19 %
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Absolue	S/O	2,32 %	11,10 %	2,88 %	2,41 %
Fonds Diversified Income Fund	Relative	1/3 de chacun des Indices Bloomberg Global Aggregate Credit ex Emerging Markets, couvert en USD, ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index, couvert en USD et JPMorgan EMBI Global, couvert en USD	98,55 %	107,94 %	103,05 %	102,79 %
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Absolue	S/O	4,77 %	7,60 %	5,67 %	5,23 %
Fonds Dynamic Bond Fund	Absolue	S/O	1,73 %	3,11 %	2,23 %	2,72 %
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	Absolue	S/O	4,74 %	9,51 %	6,27 %	5,59 %
Fonds Emerging Local Bond Fund	Relative	Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert)	94,11 %	110,67 %	105,05 %	94,11 %
Fonds Emerging Markets Bond Fund	Relative	Indice JPMorgan Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global	106,90 %	114,19 %	110,28 %	107,17 %
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	Relative	Indice JPMorgan ESG Emerging Markets Bond Index (EMBI) Global Diversified	103,52 %	111,23 %	108,03 %	106,41 %
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	Relative	Indice JPMorgan Corporate Emerging Markets Bond Index Diversified (CEMBI)	106,41 %	120,75 %	113,09 %	111,22 %
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Relative	50 % de l'Indice JPMorgan EMBI Global Index / 50 % de l'Indice JPMorgan Government Bond Index-Emerging Markets Global Diversified Index (non couvert en USD)	46,26 %	75,87 %	63,77 %	54,78 %
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Relative	Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert)	90,59 %	123,04 %	108,80 %	92,20 %
Fonds PIMCO ESG Income Fund	Absolue	S/O	0,32 %	1,87 %	1,46 %	1,77 %
Fonds Euro Bond Fund	Relative	Indice FTSE Euro Broad Investment-Grade Index	99,37 %	120,35 %	108,31 %	101,36 %
Fonds Euro Credit Fund	Relative	Indice Bloomberg Euro-Aggregate Credit Index	98,09 %	111,31 %	105,31 %	104,06 %
Fonds Euro Income Bond Fund	Absolue	S/O	2,57 %	3,88 %	3,12 %	2,91 %
Fonds Euro Long Average Duration Fund	Relative	Indice Bloomberg Euro Government (Germany, France, Netherlands) over 15 years Index	96,67 %	104,01 %	99,96 %	98,33 %
Fonds Euro Short-Term Fund	Absolue	S/O	0,51 %	0,89 %	0,65 %	0,68 %
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	Relative	Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B European Currency High Yield Constrained Index	88,35 %	100,64 %	94,40 %	91,94 %
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Absolue	S/O	1,91 %	2,80 %	2,34 %	2,63 %
Fonds Global Advantage Fund	Relative	Indice PIMCO Global Advantage Bond Index (GLADI) (clôture de la Bourse de Londres)	97,53 %	126,44 %	110,80 %	103,88 %
Fonds Global Bond Fund	Relative	Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD)	80,34 %	114,27 %	93,99 %	86,27 %
Fonds Global Bond ESG Fund	Relative	Indice Bloomberg Global Aggregate Index (couvert en USD)	80,89 %	111,03 %	93,22 %	89,27 %
Fonds Global Bond Ex-US Fund	Relative	Indice Bloomberg Global Aggregate ex-USD Index (couvert en USD)	78,38 %	126,22 %	94,84 %	84,52 %
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Relative	60 % de l'Indice MSCI All Country World Index/40 % de l'Indice Bloomberg Global Aggregate couvert en USD	115,77 %	137,13 %	127,83 %	119,70 %
Fonds Global High Yield Bond Fund	Relative	Indice ICE BofA Merrill Lynch BB-B Rated Developed Markets High Yield Constrained Index couvert en USD	92,27 %	117,02 %	103,43 %	105,07 %
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	Relative	Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD)	94,57 %	110,53 %	102,31 %	98,87 %
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	Relative	Indice Bloomberg Global Aggregate Credit Index (couvert en USD)	97,63 %	109,78 %	102,98 %	100,08 %
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	Relative	Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond 1-5 Year Index (couvert en USD)	107,97 %	131,84 %	119,54 %	113,96 %
Fonds Global Real Return Fund	Relative	Indice Bloomberg World Government Inflation-Linked Bond Index (couvert en USD)	96,46 %	109,06 %	102,26 %	97,35 %
Fonds Income Fund	Absolue	S/O	3,33 %	5,18 %	4,03 %	3,87 %
Fonds Income Fund II	Absolue	S/O	0,43 %	2,74 %	2,14 %	2,06 %
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	Absolue	S/O	6,22 %	11,55 %	8,04 %	6,26 %
Fonds Low Average Duration Fund	Absolue	S/O	0,49 %	2,01 %	0,91 %	1,61 %
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Relative	Indice Bloomberg Global Aggregate Credit 1-5 Years Index (couvert en USD)	98,11 %	144,31 %	118,98 %	98,11 %

Fonds	Méthodologie	Indice de référence	31 décembre 2021 Min	Max	Moyenne	Fin d'exercice
Fonds Low Duration Income Fund	Absolue	S/O	2,73 %	4,12 %	3,23 %	3,03 %
Fonds Low Duration Opportunities Fund	Absolue	S/O	1,22 %	2,13 %	1,52 %	1,94 %
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Relative	Indice Alerian MLP Index	88,39 %	102,56 %	93,90 %	94,52 %
Fonds Mortgage Opportunities Fund	Absolue	S/O	2,37 %	4,31 %	3,08 %	2,98 %
Fonds StocksPLUS™ Fund	Relative	Indice S&P 500 Index (net de la retenue à la source des dividendes)	94,94 %	108,47 %	101,66 %	99,96 %
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Relative	Indice S&P 500 Index (net de la retenue à la source des dividendes)	97,64 %	113,30 %	103,74 %	101,67 %
Fonds Strategic Income Fund	Relative	75 % de l'Indice Bloomberg Global Aggregate couvert en USD/25 % de l'Indice MSCI World Value Index	121,10 %	189,50 %	149,77 %	132,34 %
Fonds Total Return Bond Fund	Relative	Indice Bloomberg U.S. Aggregate Index	89,59 %	110,10 %	99,19 %	100,60 %
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Absolue	S/O	3,62 %	7,36 %	5,41 %	4,68 %
Fonds UK Corporate Bond Fund	Relative	Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts Index	97,78 %	111,79 %	102,43 %	97,78 %
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	Relative	Indice ICE BofA Merrill Lynch Sterling Non-Gilts 10+ Index	95,90 %	106,08 %	99,11 %	96,62 %
Fonds US High Yield Bond Fund	Relative	Indice ICE BofA Merrill Lynch US High Yield Constrained Index	92,05 %	112,68 %	104,14 %	103,58 %
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	Relative	Indice Bloomberg U.S. Credit Index	94,70 %	106,14 %	99,91 %	95,52 %
Fonds US Short-Term Fund	Absolue	S/O	0,41 %	0,90 %	0,65 %	0,74 %

La Banque centrale exige de tous les fonds qu'ils présentent une mesure de leur endettement calculée sur la base de l'exposition notionnelle brute. L'exposition notionnelle brute est calculée à partir de la somme des valeurs absolues des montants notionnels des instruments financiers dérivés (réputée comprendre certaines opérations de règlement à terme), comme l'exige la Banque centrale et, de ce fait, ne prend pas en considération les arrangements de compensation et de couverture mis en place par le Fonds à tout moment. L'utilisation d'instruments financiers dérivés, que ce soit à des fins de couverture ou d'investissement, peut donner lieu à une exposition notionnelle brute plus importante. L'exposition notionnelle brute du Fonds augmente normalement lorsque, par exemple, les Conseillers en investissement estiment plus approprié d'utiliser des instruments financiers dérivés pour modifier l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt, de change ou de crédit.

Le tableau suivant présente le niveau moyen de l'exposition notionnelle brute des Fonds pour les exercices clos les 31 décembre 2022 et 31 décembre 2021 :

Fonds	31 décembre 2022	31 décembre 2021
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	46 %	42 %
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	47 %	42 %
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	104 %	93 %
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	81 %	69 %
Fonds Commodity Real Return Fund	258 %	263 %
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	145 %	185 %
Fonds Diversified Income Fund	118 %	105 %
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	119 %	127 %
Fonds Diversified Income ESG Fund	79 %(1)	S/O
Fonds Dynamic Bond Fund	232 %	150 %
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	229 %	118 %
Fonds Emerging Local Bond Fund	500 %	500 %
Fonds Emerging local Bond ESG Fund	123 %(1)	S/O
Fonds Emerging Markets Bond Fund	80 %	49 %
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	61 %	41 %
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	46 %	34 %
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	461 %	463 %
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	465 %	384 %
Fonds PIMCO ESG Income Fund	120 %	80 %(2)
Fonds Euro Bond Fund	227 %	211 %
Fonds Euro Credit Fund	118 %	112 %
Fonds Euro Income Bond Fund	177 %	143 %
Fonds Euro Long Average Duration Fund	265 %	261 %
Fonds Euro Short-Term Fund	124 %	81 %
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	58 %	50 %
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	302 %	269 %
Fonds Global Advantage Fund	398 %	314 %
Fonds Global Bond Fund	404 %	338 %
Fonds Global Bond ESG Fund	321 %	237 %
Fonds Global Bond Ex-US Fund	454 %	367 %
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	267 %	329 %
Fonds Global High Yield Bond Fund	30 %	29 %
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	127 %	107 %
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	76 %	66 %
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	198 %	202 %
Fonds Global Real Return Fund	232 %	207 %
Fonds Income Fund	243 %	162 %
Fonds Income Fund II	84 %	45 %(2)
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	185 %	283 %
Fonds Low Average Duration Fund	147 %	116 %
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	105 %	80 %
Fonds Low Duration Income Fund	249 %	162 %
Fonds Low Duration Opportunities Fund	252 %	133 %
Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund	87 %(1)	S/O
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	49 %	68 %
Fonds Mortgage Opportunities Fund	569 %	484 %
Fonds StocksPLUS™ Fund	201 %	216 %
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	262 %	253 %
Fonds Strategic Income Fund	264 %	181 %
Fonds Total Return Bond Fund	181 %	116 %
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	818 %	722 %
Fonds UK Corporate Bond Fund	79 %	88 %
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	90 %	99 %
Fonds US High Yield Bond Fund	6 %	8 %
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	111 %	75 %
Fonds US Short-Term Fund	87 %	88 %

(1) Les Fonds ont été lancés au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022.
(2) Les Fonds ont été lancés au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2021.

(b) Risque de change

Si les Fonds investissent directement dans des devises étrangères ou des titres qui se négocient dans, et perçoivent des revenus dans des devises étrangères ou dans des instruments financiers dérivés qui apportent une exposition à des devises étrangères, ils seront soumis au risque que ces devises se déprécient par rapport à la devise fonctionnelle des Fonds ou, dans le cas des positions de couverture, que la devise fonctionnelle des Fonds perde de la valeur par rapport à la devise couverte. Les taux de change des pays étrangers peuvent fluctuer de manière significative sur de courtes périodes pour un certain nombre de raisons, y compris les variations des taux d'intérêt, l'intervention (ou l'impossibilité d'intervenir) par des gouvernements américains ou étrangers, des banques centrales ou des entités supranationales telles que le Fonds monétaire international, ou par l'imposition de contrôles des devises ou d'autres développements politiques aux États-Unis ou à l'étranger. Les investissements des Fonds dans des titres libellés en devise étrangère peuvent donc réduire les rendements des Fonds.

Notes relatives aux États financiers (suite)

Les Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, PIMCO Climate Bond Fund, Diversified Income ESG Fund, PIMCO ESG Income Fund, Low Average Duration Fund, Low Duration Income Fund, Low Duration Opportunities ESG Fund, PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund, PIMCO StocksPLUS™ AR Fund, UK Corporate Bond Fund et UK Long Term Corporate Bond Fund n'étaient pas considérablement exposés à des devises étrangères au 31 décembre 2022 ou au 31 décembre 2021. Les tableaux suivants présentent l'exposition totale au risque de change dans les devises si cette exposition est jugée importante (c'est-à-dire, toutes autres variables étant égales, l'impact d'un mouvement raisonnablement possible du taux de change occasionnerait un mouvement important de l'actif net) (en milliers) :

Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Renminbi chinois (Offshore)	$ 5	$ (604)	$ (599)	$ 2	$ (8 200)	$ (8 198)
Euro	2 881	(2 766)	115	9 816	(19 663)	(9 847)
	$ 2 886	$ (3 370)	$ (484)	$ 9 818	$ (27 863)	$ (18 045)

Fonds PIMCO Capital Securities Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Euro	$ 2 368 944	$ (2 418 200)	$ (49 256)	$ 3 794 319	$ (7 699 654)	$ (3 905 335)

Fonds Commodity Real Return Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Livre sterling britannique	$ 118 131	$ (121 922)	$ (3 791)	$ 96 133	$ (170 205)	$ (74 072)
Euro	305 284	(295 912)	9 372	299 802	(595 364)	(295 562)
	$ 423 415	$ (417 834)	$ 5 581	$ 395 935	$ (765 569)	$ (369 634)

Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Livre sterling britannique	$ 760	$ (891)	$ (131)	$ 3 564	$ (6 910)	$ (3 346)
Euro	2 169	(2 277)	(108)	4 412	(8 672)	(4 260)
	$ 2 929	$ (3 168)	$ (239)	$ 7 976	$ (15 582)	$ (7 606)

Fonds Diversified Income Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Euro	$ 2 279 091	$ (2 378 287)	$ (99 196)	$ 4 085 864	$ (8 143 940)	$ (4 058 076)

Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Livre sterling britannique	$ 18 549	$ (18 696)	$ (147)	$ 56 167	$ (128 378)	$ (72 211)
Euro	126 256	(132 486)	(6 230)	302 487	(608 636)	(306 149)
	$ 144 805	$ (151 182)	$ (6 377)	$ 358 654	$ (737 014)	$ (378 360)

Fonds Dynamic Bond Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Livre sterling britannique	$ 191 450	$ (170 852)	$ 20 598	$ 217 367	$ (409 767)	$ (192 400)
Euro	538 295	(598 546)	(60 251)	577 398	(1 214 842)	(637 444)
	$ 729 745	$ (769 398)	$ (39 653)	$ 794 765	$ (1 624 609)	$ (829 844)

Fonds Dynamic Multi-Asset Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Réal brésilien	€ 0	€ 114 243	€ 114 243	€ 10	€ (10 814)	€ (10 804)
Livre sterling britannique	72 902	(195 150)	(122 248)	81 843	(311 743)	(229 900)
Dollar canadien	68 142	42 315	110 457	105 550	(117 973)	(12 423)
Peso chilien	0	119 441	119 441	0	146 325	146 325
Dollar de Hong Kong	57 660	(102 774)	(45 114)	250 979	(60 596)	190 383
Forint hongrois	0	144 948	144 948	0	(165)	(165)
Roupie indienne	0	123 814	123 814	0	0	0
Shekel israélien	25 085	(170 811)	(145 726)	101 411	(182 073)	(80 662)
Couronne norvégienne	25 356	110 729	136 085	41 600	146 849	188 449
Won sud-coréen	118 056	(109 869)	8 187	100 074	54 667	154 741
Dollar de Taïwan	172 004	(366 954)	(194 950)	420 503	(45 754)	374 749
Dollar américain	1 313 859	(1 521 877)	(208 018)	1 907 323	(4 354 224)	(2 446 901)
	€ 1 853 064	€ (1 811 945)	€ 41 119	€ 3 009 293	€ (4 735 501)	€ (1 726 208)

Fonds Emerging Local Bond Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Réal brésilien	$ 72 605	$ 116 650	$ 189 255	$ 80 167	$ 35 216	$ 115 383
Peso chilien	48 276	(5 534)	42 742	108 086	(65 106)	42 980
Renminbi chinois (Chine continentale)	111 344	54 864	166 208	316 213	(119 112)	197 101
Peso colombien	92 165	(2 600)	89 565	147 850	(32 217)	115 633
Couronne tchèque	56 636	47 780	104 416	4 586	114 536	119 122
Euro	65 535	(36 905)	28 630	67 300	(147 920)	(80 620)
Forint hongrois	61 026	(734)	60 292	(559)	73 557	72 998
Roupie indonésienne	166 739	39 786	206 525	247 590	2 480	250 070
Ringgit malaisien	176 652	11 634	188 286	181 227	25 707	206 934
Peso mexicain	144 527	33 144	177 671	70 617	94 521	165 138
Nuevo Sol péruvien	46 699	(3 191)	43 508	73 627	(30 071)	43 556
Zloty polonais	8 441	107 423	115 864	39 567	113 012	152 579
Leu roumain	76 773	(15 089)	61 684	66 381	(1 976)	64 405
Rouble russe	6 084	0	6 084	126 359	21 766	148 125
Rand sud-africain	257 451	(84 444)	173 007	194 231	(12 664)	181 567
Baht thaïlandais	80 943	110 257	191 200	125 564	67 387	192 951
	$ 1 471 896	$ 373 041	$ 1 844 937	$ 1 848 806	$ 139 116	$ 1 987 922

Fonds Emerging local Bond ESG Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Réal brésilien	$ 251	$ 361	$ 612	$ S/O	$ S/O	$ S/O
Peso chilien	140	54	194	S/O	S/O	S/O
Peso colombien	233	(20)	213	S/O	S/O	S/O
Couronne tchèque	453	128	581	S/O	S/O	S/O
Forint hongrois	260	(13)	247	S/O	S/O	S/O
Roupie indonésienne	671	4	675	S/O	S/O	S/O
Ringgit malaisien	588	159	747	S/O	S/O	S/O
Peso mexicain	545	96	641	S/O	S/O	S/O
Nuevo Sol péruvien	146	3	149	S/O	S/O	S/O
Zloty polonais	371	168	539	S/O	S/O	S/O
Leu roumain	290	(15)	275	S/O	S/O	S/O
Rand sud-africain	823	(230)	593	S/O	S/O	S/O
Baht thaïlandais	283	346	629	S/O	S/O	S/O
	$ 5 054	$ 1 041	$ 6 095	$ S/O	$ S/O	$ S/O

Fonds Emerging Markets Bond Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Euro	$ 235 241	$ (239 027)	$ (3 786)	$ 265 938	$ (527 161)	$ (261 223)

Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Euro	$ 190 204	$ (201 086)	$ (10 882)	$ 203 590	$ (404 170)	$ (200 580)

Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Euro	$ 5 840	$ (5 703)	$ 137	$ 9 899	$ (19 830)	$ (9 931)

Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Dollar australien	$ 91	$ (37)	$ 54	$ 55	$ (6 709)	$ (6 654)
Réal brésilien	5 017	5 180	10 197	3 146	(1 182)	1 964
Dollar canadien	0	(89)	(89)	0	(10 370)	(10 370)
Peso chilien	208	5 420	5 628	12 087	(9 165)	2 922
Renminbi chinois (Chine continentale)	377	8 175	8 552	457	2 355	2 812
Euro	11 804	(15 001)	(3 197)	27 730	(50 263)	(22 533)
Roupie indonésienne	0	15 191	15 191	0	16 979	16 979
Ringgit malaisien	(37)	7 337	7 300	24	5 491	5 515
Rand sud-africain	10 393	(4 989)	5 404	14 068	(12 625)	1 443
Baht thaïlandais	246	4 183	4 429	(144)	4 068	3 924
Livre turque	2	(5 829)	(5 827)	85	(3 100)	(3 015)
	$ 28 101	$ 19 541	$ 47 642	$ 57 508	$ (64 521)	$ (7 013)

	Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Réal brésilien	$ 577	$ 558	$ 1 135	$ 591	$ 1 449	$ 2 040
Renminbi chinois (Chine continentale)	24	1 897	1 921	18	2 460	2 478
Couronne tchèque	193	702	895	13	1 479	1 492
Euro	582	(306)	276	854	(3 860)	(3 006)
Forint hongrois	648	(22)	626	0	743	743
Roupie indienne	0	1 657	1 657	0	2 373	2 373
Roupie indonésienne	1	945	946	0	1 645	1 645
Ringgit malaisien	76	926	1 002	193	1 519	1 712
Peso mexicain	361	1 674	2 035	266	2 147	2 413
Zloty polonais	82	1 074	1 156	22	1 608	1 630
Leu roumain	0	425	425	0	532	532
Rouble russe	14	0	14	439	1 449	1 888
Dollar de Singapour	1	1 580	1 581	75	2 104	2 179
Won sud-coréen	5	2 240	2 245	(3)	3 004	3 001
Dollar de Taïwan	0	1 325	1 325	0	1 801	1 801
Baht thaïlandais	(1)	1 084	1 083	2	1 489	1 491
Livre turque	0	766	766	0	375	375
	$ 2 563	$ 16 525	$ 19 088	$ 2 470	$ 22 317	$ 24 787

	Fonds Euro Bond Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Dollar américain	€ 271 900	€ (176 499)	€ 95 401	€ 275 761	€ (582 374)	€ (306 613)

	Fonds Euro Credit Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Dollar américain	€ 89 377	€ (81 174)	€ 8 203	€ 171 927	€ (351 213)	€ (179 286)

	Fonds Euro Income Bond Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Dollar américain	€ 292 182	€ (272 298)	€ 19 884	€ 515 062	€ (1 049 158)	€ (534 096)

	Fonds Euro Long Average Duration Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Dollar américain	€ 9 930	€ (6 060)	€ 3 870	€ 10 188	€ (9 351)	€ 837

	Fonds Euro Short-Term Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Dollar américain	€ 21 084	€ (19 481)	€ 1 603	€ 51 541	€ (112 233)	€ (60 692)

	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Dollar américain	€ 13 984	€ (14 202)	€ (218)	€ 15 971	€ (32 259)	€ (16 288)

	Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Dollar américain	€ 26 301	€ (15 271)	€ 11 030	€ 32 169	€ (68 648)	€ (36 479)

	Fonds Global Advantage Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Dollar australien	$ 17 341	$ 2 048	$ 19 389	$ 26 322	$ (4 726)	$ 21 596
Livre sterling britannique	32 405	(19 088)	13 317	45 652	(56 347)	(10 695)
Dollar canadien	2 065	6 250	8 315	3 280	2 740	6 020
Renminbi chinois (Chine continentale)	443	35 354	35 797	26 147	2 616	28 763
Renminbi chinois (Offshore)	2	9 188	9 190	0	25 769	25 769
Euro	100 213	(17 702)	82 511	96 022	3 483	99 505
Roupie indienne	2 953	11 479	14 432	3 629	15 027	18 656
Yen japonais	13 430	17 993	31 423	37 820	2 114	39 934
	$ 168 852	$ 45 522	$ 214 374	$ 238 872	$ (9 324)	$ 229 548

	Fonds Global Bond Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Dollar australien	$ 493 730	$ (113 174)	$ 380 556	$ 616 757	$ (233 570)	$ 383 187
Renminbi chinois (Chine continentale)	(623)	2 413	1 790	912 493	(38 983)	873 510
Renminbi chinois (Offshore)	1	(7 989)	(7 988)	0	(898 717)	(898 717)
Euro	2 371 161	(2 500 605)	(129 444)	2 980 153	(6 052 965)	(3 072 812)
	$ 2 864 269	$ (2 619 355)	$ 244 914	$ 4 509 403	$ (7 224 235)	$ (2 714 832)

	Fonds Global Bond ESG Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Livre sterling britannique	$ 126 350	$ (152 475)	$ (26 125)	$ 171 272	$ (352 664)	$ (181 392)
Renminbi chinois (Chine continentale)	295	(1 744)	(1 449)	150 102	(2 496)	147 606
Renminbi chinois (Offshore)	0	2 180	2 180	16	(141 142)	(141 126)
Euro	508 092	(541 044)	(32 952)	571 408	(1 150 456)	(579 048)
	$ 634 737	$ (693 083)	$ (58 346)	$ 892 798	$ (1 646 758)	$ (753 960)

	Fonds Global Bond Ex-US Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Dollar australien	$ 34 822	$ (13 053)	$ 21 769	$ 44 170	$ (21 814)	$ 22 356
Livre sterling britannique	50 859	(55 195)	(4 336)	60 394	(125 767)	(65 373)
Renminbi chinois (Chine continentale)	15 260	0	15 260	119 557	(17 860)	101 697
Renminbi chinois (Offshore)	0	(21 272)	(21 272)	9	(104 968)	(104 959)
Euro	142 277	(152 540)	(10 263)	155 400	(313 264)	(157 864)
Yen japonais	158 896	(154 003)	4 893	135 665	(173 243)	(37 578)
	$ 402 114	$ (396 063)	$ 6 051	$ 515 195	$ (756 916)	$ (241 721)

	Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Dollar australien	$ 1 028	$ 15 689	$ 16 717	$ 1 621	$ 12 176	$ 13 797
Dollar canadien	1 362	11 361	12 723	3 825	17 651	21 476
Renminbi chinois (Chine continentale)	21 768	117	21 885	47 330	(37 828)	9 502
Renminbi chinois (Offshore)	0	(22 761)	(22 761)	0	(17 507)	(17 507)
Euro	20 531	49 355	69 886	17 076	123 241	140 317
Yen japonais	161 033	(134 205)	26 828	117 040	(46 706)	70 334
	$ 205 722	$ (80 444)	$ 125 278	$ 186 892	$ 51 027	$ 237 919

	Fonds Global High Yield Bond Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Euro	$ 762 654	$ (777 633)	$ (14 979)	$ 1 132 339	$ (2 266 185)	$ (1 133 846)

	Fonds Global Investment Grade Credit Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Livre sterling britannique	$ 397 802	$ (406 970)	$ (9 168)	$ 915 032	$ (1 362 914)	$ (447 882)
Euro	1 501 589	(1 570 568)	(68 979)	3 149 786	(6 443 260)	(3 293 474)
	$ 1 899 391	$ (1 977 538)	$ (78 147)	$ 4 064 818	$ (7 806 174)	$ (3 741 356)

	Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Euro	$ 320 958	$ (322 879)	$ (1 921)	$ 301 207	$ (602 013)	$ (300 806)

	Fonds Global Low Duration Real Return Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Livre sterling britannique	$ 197 996	$ (192 629)	$ 5 367	$ 133 465	$ (259 877)	$ (126 412)
Euro	288 416	(264 829)	23 587	275 351	(551 540)	(276 189)
Yen japonais	69 215	(69 878)	(663)	59 833	(88 605)	(28 772)
	$ 555 627	$ (527 336)	$ 28 291	$ 468 649	$ (900 022)	$ (431 373)

Fonds Global Real Return Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Euro	$ 681 331	$ (709 530)	$ (28 199)	$ 1 054 070	$ (2 105 992)	$ (1 051 922)

Fonds Income Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Yen japonais	$ 2 979 968	$ (1 651 362)	$ 1 328 606	$ 2 058	$ (46 036)	$ (43 978)
Rouble russe	198 869	0	198 869	613 726	1 084 368	1 698 094
	$ 3 178 837	$ (1 651 362)	$ 1 527 475	$ 615 784	$ 1 038 332	$ 1 654 116

Fonds Income Fund II

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Peso mexicain	$ 514	$ 19	$ 533	$ 549	$ 38	$ 587
Rouble russe	0	0	0	0	604	604
	$ 514	$ 19	$ 533	$ 549	$ 642	$ 1 191

Fonds Inflation Multi-Asset Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Réal brésilien	$ 10	$ 2 746	$ 2 756	$ (1 243)	$ 19 794	$ 18 551
Peso mexicain	0	5 993	5 993	3 909	402	4 311
	$ 10	$ 8 739	$ 8 749	$ 2 666	$ 20 196	$ 22 862

Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Euro	$ 154 878	$ (155 538)	$ (660)	$ 166 379	$ (335 731)	$ (169 352)

Fonds Low Duration Opportunities Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Livre sterling britannique	$ 104 327	$ (95 964)	$ 8 363	$ 212 256	$ (401 285)	$ (189 029)
Euro	197 537	(226 587)	(29 050)	436 395	(935 342)	(498 947)
	$ 301 864	$ (322 551)	$ (20 687)	$ 648 651	$ (1 336 627)	$ (687 976)

Fonds Mortgage Opportunities Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Livre sterling britannique	$ 132 300	$ (132 680)	$ (380)	$ 173 358	$ (172 739)	$ 619
Euro	24 115	(25 159)	(1 044)	189 084	(191 731)	(2 647)
	$ 156 415	$ (157 839)	$ (1 424)	$ 362 442	$ (364 470)	$ (2 028)

Fonds StocksPLUS™ Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Livre sterling britannique	$ 35 643	$ (35 399)	$ 244	$ 218 048	$ (427 660)	$ (209 612)
Euro	174 882	(176 960)	(2 078)	376 244	(750 405)	(374 161)
	$ 210 525	$ (212 359)	$ (1 834)	$ 594 292	$ (1 178 065)	$ (583 773)

Fonds Strategic Income Fund

	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Dollar australien	$ 5 676	$ 6 403	$ 12 079	$ 10 948	$ (1 729)	$ 9 219
Réal brésilien	2 987	6 021	9 008	(819)	14 800	13 981
Livre sterling britannique	15 253	(8 988)	6 265	37 849	(51 698)	(13 849)
Euro	15 965	(9,432)	6 533	51 763	(41 206)	10 557
Yen japonais	6 770	7 884	14 654	24 809	(1 851)	22 958
	$ 46 651	$ 1 888	$ 48 539	$ 124 550	$ (81 684)	$ 42 866

	Fonds Total Return Bond Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Livre sterling britannique	$ 270 559	$ (270 912)	$ (353)	$ 500 686	$ (1 037 747)	$ (537 061)
Euro	844 203	(834 837)	9 366	1 178 687	(2 379 067)	(1 200 380)
	$ 1 114 762	$ (1 105 749)	$ 9 013	$ 1 679 373	$ (3 416 814)	$ (1 737 441)

	Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Dollar australien	$ 5 583	$ (5 848)	$ (265)	$ 757	$ (5 238)	$ (4 481)
Réal brésilien	264	13 022	13 286	807	(1 609)	(802)
Livre sterling britannique	123	5 593	5 716	1 598	(17 303)	(15 705)
Dollar canadien	16 561	(23 692)	(7 131)	282	(13 050)	(12 768)
Peso chilien	(737)	14 132	13 395	504	(2 102)	(1 598)
Renminbi chinois (Offshore)	0	(2 252)	(2 252)	208	5 850	6 058
Peso colombien	25	(5 782)	(5 757)	176	(2 568)	(2 392)
Euro	398	15	413	1 414	(9 442)	(8 028)
Forint hongrois	564	10 036	10 600	238	(1 822)	(1 584)
Roupie indienne	(1 228)	(31 304)	(32 532)	(27)	(129)	(156)
Roupie indonésienne	0	(20 219)	(20 219)	0	3 771	3 771
Shekel israélien	8 144	(35 304)	(27 160)	2 014	1 124	3 138
Yen japonais	64 494	(68 674)	(4 180)	16	(10 004)	(9 988)
Ringgit malaisien	348	3 776	4 124	114	(2 337)	(2 223)
Peso mexicain	(52)	7 371	7 319	10	2 114	2 124
Dollar néo-zélandais	0	10 948	10 948	0	(7 797)	(7 797)
Couronne norvégienne	0	(6)	(6)	0	(3 420)	(3 420)
Nuevo Sol péruvien	0	15 806	15 806	0	(773)	(773)
Leu roumain	0	17 909	17 909	0	(3 158)	(3 158)
Dollar de Singapour	(482)	9 478	8 996	47	(1 033)	(986)
Rand sud-africain	(194)	3 508	3 314	(51)	(2 079)	(2 130)
Won sud-coréen	137	3 438	3 575	120	(2 406)	(2 286)
Couronne suédoise	98	852	950	21	(5 215)	(5 194)
Franc suisse	45	9 471	9 516	134	(1 901)	(1 767)
Baht thaïlandais	116	(18 208)	(18 092)	(8)	(4 053)	(4 061)
	$ 94 207	$ (85 934)	$ 8 273	$ 8 374	$ (84 580)	$ (76 206)

	Fonds US High Yield Bond Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Euro	$ 48 285	$ (47 578)	$ 707	$ 100 205	$ (203 852)	$ (103 647)

	Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Euro	$ 3 409	$ (5 473)	$ (2 064)	$ 32 955	$ (66 261)	$ (33 306)

	Fonds US Short-Term Fund					
	Au 31 décembre 2022			Au 31 décembre 2021		
	Total	Couverture	Net	Total	Couverture	Net
Livre sterling britannique	$ 80 120	$ (79 551)	$ 569	$ 157 500	$ (327 608)	$ (170 108)
Euro	92 035	(94 533)	(2 498)	108 302	(214 719)	(106 417)
	$ 172 155	$ (174 084)	$ (1 929)	$ 265 802	$ (542 327)	$ (276 525)

(c) Risque de taux d'intérêt
Le risque de taux d'intérêt est le risque que les titres à revenu fixe perdent de la valeur en raison de fluctuation des taux d'intérêt. Si un taux d'intérêt nominal augmente, la valeur de certains titres à revenu fixe détenus par les Fonds a toutes les chances de baisser. On peut décrire un taux d'intérêt nominal comme la somme d'un taux d'intérêt réel et du taux d'inflation prévu. Les titres à revenu fixe dotés de longues durations tendent à être plus sensibles aux fluctuations des taux d'intérêt, ce qui en fait des titres plus volatils que ceux assortis d'une duration plus courte. La duration sert principalement de mesure de la sensibilité de la variation des prix de marché des titres à revenu fixe en fonction des taux d'intérêt (c'est-à-dire le rendement).

Tous les Fonds investis principalement dans des instruments à revenu fixe sont donc exposés aux risques associés aux effets des fluctuations des taux d'intérêt en vigueur sur le marché sur leur situation financière et leurs flux de trésorerie. Ces investissements sont présentés dans le Tableau des investissements. Les liquidités et quasi-liquidités excédentaires sont investies à des taux d'intérêt du marché à court terme.

La sensibilité de l'exposition de la Société au risque de taux d'intérêt est incluse dans les calculs de la VaR globale divulgués dans la Note 16 (a).

(d) Risque de liquidité
L'exposition d'un Fonds au risque de liquidité est principalement affectée par le rachat d'actions. Les actionnaires participants peuvent racheter tout ou partie de leurs actions en circulation conformément au Prospectus. Les actions rachetables sont rachetées à la demande des actionnaires et sont reprises au Bilan. Les actifs du Fonds se composent essentiellement de titres facilement réalisables, qu'il est possible de vendre rapidement pour satisfaire aux demandes de rachat des actionnaires, conformément au Prospectus. Le risque de liquidité survient lorsque des investissements particuliers sont difficiles à acheter ou à vendre. En outre, les titres illiquides peuvent être plus difficiles à valoriser, notamment sur des marchés volatils. Les investissements d'un Fonds dans des titres illiquides peuvent réduire ses rendements, car il peut être dans l'incapacité de vendre les titres illiquides à un moment ou un prix avantageux. Les Fonds dont les stratégies d'investissement principales impliquent des titres étrangers, des instruments financiers dérivés ou des titres assortis d'un risque de marché et/ou de crédit important ont tendance à avoir la plus grande exposition au risque de liquidité.

Par ailleurs, le marché de certains titres peut devenir illiquide dans des conditions économiques ou de marché défavorables, indépendamment de toute évolution défavorable de la situation d'un émetteur en particulier. Le cas échéant, un Fonds, en raison des restrictions imposées sur les investissements dans des titres illiquides et de la difficulté d'acheter et de vendre ces titres ou ces instruments, peut ne pas être en mesure d'atteindre le niveau d'exposition souhaité à un secteur donné. Dans la mesure où les principales stratégies d'investissement d'un Fonds impliquent des titres de sociétés possédant des capitalisations boursières plus petites, des titres étrangers, des secteurs illiquides de titres à revenu fixe ou des titres présentant un risque de marché et/ou de crédit important, le Fonds présentera également l'exposition au risque de liquidité la plus importante. De plus, les titres à revenu fixe assortis de durations plus longues jusqu'à l'échéance comportent un risque de liquidité plus élevé que les titres à revenu fixe qui possèdent des durations plus courtes.

Enfin, le risque de liquidité désigne également le risque de recevoir un nombre de demandes de rachat exceptionnellement élevé ou d'autres conditions anormales du marché susceptibles d'empêcher un Fonds d'honorer pleinement les demandes de rachat dans le délai imparti. Afin de pouvoir honorer ces demandes de rachat, un Fonds peut être contraint de vendre des titres à des prix réduits ou à des conditions défavorables, ce qui entraînerait une diminution de sa valeur. Il se peut également que d'autres opérateurs de marché tentent de liquider leurs titres à revenu fixe en même temps qu'un Fonds, ce qui entraînerait une augmentation de l'offre sur le marché et aggraverait le risque de liquidité et la pression à la baisse sur les prix.

Pour tous les Fonds, la Société est en droit de limiter le nombre d'actions d'un Fonds rachetées un Jour de négociation à 10 % du nombre total d'actions de ce Fonds en circulation. Dans ce cas, la Société réduira au prorata toute demande de rachat ce Jour de négociation et traitera les demandes de rachat comme si elles avaient été reçues chaque Jour de négociation suivant jusqu'à ce que toutes les actions auxquelles la demande initiale a été liée aient été rachetées.

Les Statuts de la Société contiennent des dispositions spéciales lorsqu'une demande de rachat reçue d'un actionnaire entraînerait le rachat par la Société de plus de 5 % de la Valeur Nette d'Inventaire des Actions d'un Fonds lors d'un Jour de négociation. Dans ce cas, la Société, à son entière discrétion (sauf indication contraire dans le Supplément du Fonds concerné), peut satisfaire la demande de rachat par le transfert en espèces (en nature) à l'actionnaire des actifs du Fonds concerné ayant une valeur égale au prix de rachat des actions rachetées comme si le produit du rachat était payé en numéraire moins les frais de rachat et autres frais du transfert, à condition que cette distribution ne soit pas préjudiciable aux intérêts des actionnaires restants de ce Fonds. Lorsque l'actionnaire demandant ce rachat reçoit un avis de l'intention de la Société de choisir de satisfaire la demande de rachat par une telle distribution d'actifs, cet actionnaire peut exiger de la Société, au lieu de transférer ces actifs, qu'elle organise leur vente et le paiement du produit de la vente à cet actionnaire, dont le coût sera supporté par l'actionnaire concerné.

Pour atténuer les effets de la dilution, les Administrateurs peuvent, à leur discrétion, procéder à un ajustement du swing price de la VNI par action.

Les éléments de passif courant connus des Fonds sont identifiés dans le Bilan et la majorité de ces passifs sont exigibles à moins de trois mois, à l'exception des obligations liées aux instruments financiers dérivés et aux titres vendus à découvert. Les dates d'échéance contractuelles les plus précoces pour les passifs liés aux instruments financiers dérivés sont indiquées dans le Tableau des investissements.

Les instruments financiers dérivés se composent de la juste valeur des contrats de change à terme, des contrats à terme standardisés, des contrats d'options et des contrats de swap en fin d'exercice. Les instruments financiers dérivés sont des actifs et passifs détenus à des fins de transaction, acquis principalement dans le but de vente à court terme. Comme il n'est pas prévu que les instruments soient détenus jusqu'à échéance ou résiliation, la juste valeur actuelle représente le flux de trésorerie estimé qui peut être requis pour céder les positions. Les flux de trésorerie à venir des Fonds et le passif réalisé peuvent différer du passif à court terme en raison des changements des conditions du marché.

Les Conseillers en investissement gèrent le risque de liquidité en surveillant les portefeuilles et investissements jugés illiquides ou non cessibles immédiatement ou facilement, afin de garantir qu'il y ait suffisamment d'actifs liquides pour couvrir l'encours des passifs des Fonds.

Certains Fonds peuvent avoir une base d'actionnaires concentrée lorsque de grands actionnaires institutionnels détiennent une part importante de l'actif net d'un Fonds. Cela expose les autres actionnaires du Fonds à certains risques. Ces risques comprennent le risque qu'une grande partie des actifs d'un Fonds puisse être rachetée n'importe quel jour, ce qui pourrait avoir un impact sur la viabilité globale du Fonds ou sur la capacité des autres actionnaires, qui n'ont pas soumis de demandes de rachat ce jour-là, de procéder au rachat auprès du Fonds, par exemple lorsqu'il peut s'avérer nécessaire d'imposer une date de rachat. Les Fonds ci-dessous sont exposés à un risque de concentration important, car ils ont des actionnaires qui détiennent plus de 20 % de l'Actif net du Fonds. Une telle concentration des intérêts des actionnaires pourrait avoir un effet important sur le Fonds si cet actionnaire demande le retrait de montants importants de capital. Les montants en pourcentage de participation détenus par le Groupe Allianz, les Fonds de la Société, les Fonds affiliés à la Société et les employés des Conseillers en investissement ne sont pas indiqués ci-dessous, car ils sont communiqués séparément à la Note 14.

	31 décembre 2022		31 décembre 2021	
Nom du Fonds	**Nom de l'actionnaire**	**Participation en %**	**Nom de l'actionnaire**	**Participation en %**
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Actionnaire C	S/O	Actionnaire C	23,29
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	Actionnaire R	S/O	Actionnaire R	23,81
Fonds Commodity Real Return Fund	Actionnaire A	21,10	Actionnaire A	23,58
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Actionnaire B	22,79	Actionnaire B	S/O
Fonds Dynamic Bond Fund	Actionnaire F	34,98	Actionnaire F	S/O
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	Actionnaire O	54,14	Actionnaire O	54,07
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Actionnaire R	31,08	Actionnaire R	77,69

Nom du Fonds	31 décembre 2022		31 décembre 2021	
	Nom de l'actionnaire	Participation en %	Nom de l'actionnaire	Participation en %
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Actionnaire E	S/O	Actionnaire E	25,68
Fonds Euro Bond Fund	Actionnaire J	22,29	Actionnaire J	S/O
Fonds Euro Credit Fund	Actionnaire K	20,35	Actionnaire K	S/O
Fonds Euro Long Average Duration Fund	Actionnaire M	36,92	Actionnaire M	39,37
Fonds Euro Short-Term Fund	Actionnaire L	20,79	Actionnaire L	S/O
Fonds Euro Short-Term Fund	Actionnaire Q	S/O	Actionnaire Q	20,50
Fonds Euro Short-Term Fund	Actionnaire W	24,59	Actionnaire W	S/O
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Actionnaire D	27,37	Actionnaire D	29,26
Fonds Global Advantage Fund	Actionnaire N	29,19	Actionnaire N	27,92
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Actionnaire T	30,91	Actionnaire T	32,42
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	Actionnaire S	20,85	Actionnaire S	S/O
Fonds Income Fund II	Actionnaire U	46,97	Actionnaire U	S/O
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Actionnaire I	S/O	Actionnaire I	43,67
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Actionnaire Y	46,86	Actionnaire Y	S/O
Fonds Low Duration Income Fund	Actionnaire I	S/O	Actionnaire I	49,78
Fonds Low Duration Income Fund	Actionnaire Y	54,34	Actionnaire Y	S/O
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Actionnaire P	S/O	Actionnaire P	24,33
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Actionnaire AA	34,76	Actionnaire AA	S/O
Fonds Mortgage Opportunities Fund	Actionnaire V	S/O	Actionnaire V	23,24
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Actionnaire X	S/O	Actionnaire X	52,54
Fonds UK Corporate Bond Fund	Actionnaire G	S/O	Actionnaire G	32,69
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	Actionnaire H	44,00	Actionnaire H	35,82
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	Actionnaire Z	S/O	Actionnaire Z	34,45

(e) Risques de crédit et de contrepartie

Les Fonds sont exposés au risque de crédit des parties avec lesquelles ils traitent ; ils supportent également le risque de défaillance de règlement. Les Fonds négocient avec des contreparties qui, à l'heure actuelle, ont une notation minimum de BBB/Baa2. Les Fonds minimisent les concentrations de risque de crédit par le biais de transactions effectuées avec un grand nombre de clients et de contreparties sur des bourses de valeurs reconnues et fiables, s'il y a lieu. Les opérations sur instruments financiers dérivés hors cote sont soumises au risque qu'une contrepartie à l'opération ne s'acquitte pas de ses obligations contractuelles vis-à-vis de l'autre partie, car un grand nombre des protections dont bénéficient les opérations sur produits dérivés compensées ne sont pas accessibles aux opérations sur instruments financiers dérivés hors cote. En ce qui concerne les instruments financiers dérivés négociés sur des marchés boursiers ou dans des chambres de compensation, le principal risque de crédit est la solvabilité du courtier chargé de la compensation, de la bourse ou de la chambre de compensation elle-même du Fonds. Les Fonds peuvent perdre de l'argent si l'émetteur ou le garant d'un titre à revenu fixe, ou la contrepartie à un contrat d'instrument financier dérivé, un contrat de mise en pension ou un prêt de titres en portefeuille, n'est pas en mesure ou refuse de faire les paiements de principal et/ou d'intérêts en temps voulu, ou d'honorer autrement ses obligations. Les titres et les instruments financiers dérivés sont soumis à différents niveaux de risque de crédit, qui se reflètent souvent dans les cotes de solvabilité (notation).

De la même manière, les Fonds peuvent être exposés au risque de contrepartie ou risque qu'une institution ou une autre entité avec laquelle les Fonds ont des opérations non réglées ou en cours ne remplira pas ses obligations. PIMCO, en tant que Conseillers en investissement, réduit au minimum les risques de contrepartie pour le Fonds par différentes méthodes. Avant de conclure une opération avec une nouvelle contrepartie, la Commission des risques de la Contrepartie de PIMCO procède à un contrôle de crédit approfondi et doit approuver l'utilisation de cette contrepartie. Par ailleurs, conformément aux conditions du contrat sous-jacent, dans la mesure où les montants impayés dus à un Fonds dépassent un seuil prédéterminé, la contrepartie devra avancer une garantie au Fonds sous la forme de liquidités ou de titres d'une valeur égale au montant impayé dû audit Fonds. Les Fonds peuvent investir ces garanties dans des titres ou autres instruments et paieront normalement à la contrepartie un intérêt sur la garantie reçue. Si le montant impayé dû à chaque Fonds diminue par la suite, le Fonds devra rendre à la contrepartie tout ou une partie de la garantie qui a été précédemment avancée.

Toutes les transactions sur les valeurs inscrites à la cote sont réglées/payées à la livraison en utilisant des contreparties agréées. Le risque de défaut de paiement est jugé minimal, car la livraison des titres vendus se fait uniquement lorsque les Fonds ont perçu le versement. Le versement est effectué sur une acquisition une fois que les titres ont été livrés par la contrepartie. L'échange ne peut avoir lieu si l'une des parties ne respecte pas son engagement.

Contrats généraux de compensation Certains Fonds sont soumis à divers contrats généraux de compensation auprès de certaines contreparties (« Contrats cadres »). Les Contrats cadres régissent les modalités de certaines transactions et réduisent le risque de contrepartie associé aux transactions en définissant des mécanismes de protection du crédit et en prévoyant une normalisation qui améliore la certitude juridique. Chaque type de Contrat cadre régit certains types de transactions. Différents types de transactions peuvent être négociés par différentes entités juridiques ou sociétés affiliées à une organisation donnée, ce qui rend nécessaire de conclure plusieurs accords avec une même contrepartie. Comme les Contrats cadres sont propres à des opérations particulières de différents types d'actifs, ils permettent aux Fonds de liquider et de réduire son exposition totale à une contrepartie en cas de défaillance pour toutes les transactions régies par un même Contrat cadre avec cette contrepartie. Pour les besoins de la présentation de l'information financière, le Bilan présente généralement les actifs et passifs dérivés sur une base brute, qui reflète l'intégralité des risques et expositions avant la compensation.

Les Contrats cadres peuvent également permettre de limiter le risque de contrepartie en spécifiant les accords de garanties données à des niveaux d'exposition préétablis. En vertu des Contrats cadres, la garantie est systématiquement transférée si l'exposition totale nette à certaines transactions (nette des garanties existantes déjà en place) régies par le Contrat cadre concerné avec une contrepartie d'un compte donné dépasse un seuil spécifié, qui varie généralement de zéro à 250 000 $ en fonction de la contrepartie et du type de Contrat cadre. Les bons du Trésor américain et les liquidités en dollars américains sont généralement les formes de garanties privilégiées, bien que d'autres formes de titres notés AAA puissent être utilisées en fonction des conditions énoncées dans le Contrat cadre applicable. Des titres et des espèces nantis en garantie sont inscrits à l'actif du Bilan en tant qu'un composant des Actifs financiers à leur juste valeur par résultat (valeurs mobilières) ou Dépôts auprès de contrepartie (espèces). Les garanties en espèces reçues ne sont pas normalement gardées sur un compte distinct et sont donc inscrits au passif du Bilan en tant que Dépôts des contreparties. La juste valeur de tous titres reçus en tant que garantie n'est pas comptabilisée comme composant de la VNI. L'exposition globale des Fonds au risque de contrepartie peut varier fortement sur une courte période, car elle subit l'impact de chaque transaction qui relève du Contrat cadre.

Les Contrats cadres de mise en pension et/ou les Contrats cadres globaux de mise en pension (individuellement et collectivement les « Contrats cadres de mise en pension ») régissent les opérations de mise en pension, prise en pension et vente et rachat dos-à-dos entre les Fonds et des contreparties sélectionnées. Les Contrats cadres de mise en pension comportent des dispositions relatives, entre autres, à la création, aux paiements de revenus, aux événements de défaillance et à la maintenance d'une garantie. La juste valeur des transactions relevant du Contrat cadre de mise en pension, les garanties nanties ou reçues et l'exposition nette par contrepartie en fin d'exercice sont présentées dans les Notes relatives au Tableau des investissements.

Les Contrats cadres de transaction à terme (« Contrats cadres à terme ») régissent certaines opérations de règlement à terme, telles que les titres TBA, les opérations de livraison différée ou de vente et rachat dos-à-dos effectuées par et entre les Fonds et certaines contreparties. Les Contrats cadres à terme conservent des dispositions pour, entre autres, l'initiation et la confirmation, le paiement et le transfert, les cas de défaillance, la résiliation et le maintien de la garantie.

La juste valeur des transactions à terme, les garanties nanties ou reçues et l'exposition nette par contrepartie en fin d'exercice sont présentées dans les Notes relatives au Tableau des investissements.

Les Contrats cadres et Annexes de soutien au crédit de l'International Swaps and Derivatives Association, Inc. (« Contrats cadres de l'ISDA ») régissent les transactions bilatérales sur instruments financiers dérivés hors cote conclus par les Fonds et certaines contreparties. Les Contrats cadres de l'ISDA comportent des dispositions relatives aux obligations d'ordre général, aux déclarations, contrats, garanties et cas de défaillance ou résiliation. Parmi les causes de rupture, citons les conditions qui donnent droit aux contreparties à une rupture anticipée et imposent de régler toutes les transactions en cours aux termes du Contrat cadre de l'ISDA applicable. La décision de mettre fin par anticipation peut avoir des effets importants sur les états financiers. Dans des circonstances limitées, le Contrat cadre de l'ISDA peut contenir des dispositions supplémentaires qui offre une protection supplémentaire vis-à-vis de la contrepartie allant au-delà de la couverture de l'exposition quotidienne existante si la qualité de crédit de la contrepartie s'est détériorée en deçà d'un niveau préétabli. Ces montants, le cas échéant, peuvent (ou si la loi l'exige) être séparés par un dépositaire tiers. La juste valeur des instruments financiers dérivés hors cote, les garanties nanties ou reçues et l'exposition nette par contrepartie en fin d'exercice sont présentées dans les Notes relatives au Tableau des investissements. Les Conseillers en investissement procèdent à une recherche et à une analyse approfondies pour déterminer et quantifier le risque de crédit au sein des Fonds. Le risque de crédit au sein des Fonds est examiné fréquemment par les Conseillers en investissement pour générer des résultats à travers des placements effectués ou évités. Les titres sont soumis à différents niveaux de risque de crédit, qui se reflètent souvent dans des cotes de solvabilité (notation). Les tableaux ci-dessous résument la composition de la notation de crédit pour chacun des actifs nets du Fonds.

	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund		Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund		Fonds PIMCO Capital Securities Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
« Investment Grade »	34 %	39 %	70 %	65 %	76 %	72 %
« Non-Investment Grade »	66 %	61 %	30 %	35 %	24 %	28 %
Sans notation	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Fonds PIMCO Climate Bond Fund		Fonds Commodity Real Return Fund		Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
« Investment Grade »	91 %	82 %	99 %	98 %	68 %	41 %
« Non-Investment Grade »	9 %	18 %	1 %	2 %	32 %	59 %
Sans notation	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Fonds Diversified Income Fund		Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund		Fonds Diversified Income ESG Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
« Investment Grade »	79 %	73 %	71 %	65 %	69 %	S/O
« Non-Investment Grade »	21 %	27 %	29 %	35 %	31 %	S/O
Sans notation	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	S/O
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	S/O

	Fonds Dynamic Bond Fund		Fonds Dynamic Multi-Asset Fund		Fonds Emerging Local Bond Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
« Investment Grade »	87 %	78 %	96 %	94 %	75 %	76 %
« Non-Investment Grade »	13 %	22 %	4 %	6 %	25 %	24 %
Sans notation	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Fonds Emerging Local Bond ESG Fund		Fonds Emerging Markets Bond Fund		Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
	87 %	S/O	67 %	58 %	66 %	57 %
« Investment Grade »	13 %	S/O	33 %	42 %	34 %	43 %
« Non-Investment Grade »	0 %	S/O	0 %	0 %	0 %	0 %
Sans notation	100 %	S/O	100 %	100 %	100 %	100 %

	Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund		Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
« Investment Grade »	75 %	59 %	84 %	63 %	83 %	82 %
« Non-Investment Grade »	25 %	41 %	16 %	37 %	17 %	18 %
Sans notation	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Fonds PIMCO ESG Income Fund		Fonds Euro Bond Fund		Fonds Euro Credit Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
« Investment Grade »	88 %	70 %	97 %	96 %	97 %	97 %
« Non-Investment Grade »	12 %	30 %	3 %	4 %	3 %	3 %
Sans notation	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Fonds Euro Income Bond Fund		Fonds Euro Long Average Duration Fund		Fonds Euro Short-Term Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
« Investment Grade »	82 %	74 %	100 %	96 %	97 %	92 %
« Non-Investment Grade »	18 %	26 %	0 %	4 %	3 %	8 %
Sans notation	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund		Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		Fonds Global Advantage Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
« Investment Grade »	44 %	29 %	95 %	93 %	90 %	89 %
« Non-Investment Grade »	56 %	71 %	5 %	7 %	10 %	11 %
Sans notation	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Fonds Global Bond Fund		Fonds Global Bond ESG Fund		Fonds Global Bond Ex-US Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
« Investment Grade »	96 %	94 %	97 %	91 %	93 %	92 %
« Non-Investment Grade »	4 %	6 %	3 %	9 %	7 %	8 %
Sans notation	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		Fonds Global High Yield Bond Fund		Fonds Global Investment Grade Credit Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
« Investment Grade »	93 %	93 %	22 %	15 %	90 %	89 %
« Non-Investment Grade »	7 %	7 %	78 %	85 %	10 %	11 %
Sans notation	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund		Fonds Global Low Duration Real Return Fund		Fonds Global Real Return Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
« Investment Grade »	94 %	87 %	100 %	100 %	99 %	99 %
« Non-Investment Grade »	6 %	13 %	0 %	0 %	1 %	1 %
Sans notation	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Fonds Income Fund		Fonds Income Fund II		Fonds Inflation Multi-Asset Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
« Investment Grade »	77 %	72 %	70 %	67 %	97 %	97 %
« Non-Investment Grade »	23 %	28 %	30 %	33 %	3 %	3 %
Sans notation	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Fonds Low Average Duration Fund		Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		Fonds Low Duration Income Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
« Investment Grade »	99 %	97 %	93 %	91 %	80 %	69 %
« Non-Investment Grade »	1 %	3 %	7 %	9 %	20 %	31 %
Sans notation	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Fonds Low Duration Opportunities Fund		Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund		Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
« Investment Grade »	87 %	89 %	97 %	S/O	100 %	100 %
« Non-Investment Grade »	13 %	11 %	3 %	S/O	0 %	0 %
Sans notation	0 %	0 %	0 %	S/O	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	S/O	100 %	100 %

	Fonds Mortgage Opportunities Fund		Fonds StocksPLUS™ Fund		Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
« Investment Grade »	71 %	80 %	85 %	95 %	94 %	91 %
« Non-Investment Grade »	29 %	20 %	15 %	5 %	6 %	9 %
Sans notation	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Fonds Strategic Income Fund		Fonds Total Return Bond Fund		Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
« Investment Grade »	76 %	69 %	96 %	93 %	95 %	93 %
« Non-Investment Grade »	24 %	31 %	4 %	7 %	5 %	7 %
Sans notation	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Fonds UK Corporate Bond Fund		Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund		Fonds US High Yield Bond Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
« Investment Grade »	98 %	95 %	97 %	94 %	20 %	12 %
« Non-Investment Grade »	2 %	5 %	3 %	6 %	80 %	88 %
Sans notation	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %	100 %

	Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund		Fonds US Short-Term Fund	
	31 décembre 2022	31 décembre 2021	31 décembre 2022	31 décembre 2021
« Investment Grade »	95 %	89 %	99 %	98 %
« Non-Investment Grade »	5 %	11 %	1 %	2 %
Sans notation	0 %	0 %	0 %	0 %
	100 %	100 %	100 %	100 %

Quasiment toutes les valeurs mobilières de la Société au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 sont détenues en fiducie par State Street Custodial Services (Ireland) Limited (le « Dépositaire »). Ces actifs sont détenus sur des comptes séparés pour chaque Fonds (conformément au Règlement OPCVM de la Banque centrale), ce qui réduit le risque de crédit lié à la détention des actifs à des fins de garde. Toutefois, la Société reste exposée au risque de crédit de l'établissement de crédit qui détient ses dépôts.

La notation de crédit à long terme de State Street Corporation, la société mère ultime du Dépositaire, au 31 décembre 2022 était AA- (31 décembre 2021 : AA-) telle qu'émise par l'agence de notation Fitch.

17. TRANSACTIONS AVEC DES PERSONNES LIÉES POUR LES FONDS DISTRIBUÉS À HONG KONG

Les personnes liées du Gestionnaire, des Conseillers en investissement et/ou des Conseillers en investissement par délégation, du Dépositaire et des Administrateurs de la Société sont celles définies dans le Code relatif aux SICAV et aux Fonds communs de placement de la Commission des opérations sur titres et contrats à terme standardisés de Hong Kong (le « Code de la SFC »). Toutes les transactions conclues au cours de l'exercice entre les Fonds agréés par la SFC (« Fonds agréés par la SFC »), comme indiqué dans la section des caractéristiques générales du rapport annuel, et le Gestionnaire, les Conseillers en investissement et/ou les Conseillers en investissement par délégation, le Dépositaire et les Administrateurs de la Société et leurs Personnes liées respectives ont été exécutées dans le cours habituel des activités et dans des conditions commerciales normales.

Les transactions exécutées par l'intermédiaire d'un courtier qui est une Personne liée du Gestionnaire, des Conseillers en investissement et/ou des Conseillers en investissement par délégation, du Dépositaire et des Administrateurs de la Société étaient les suivantes pour les exercices clos le 31 décembre 2022 et le 31 décembre 2021 :

	31 décembre 2022		31 décembre 2021	
Fonds	Total des achats et des ventes (en milliers)	% du Total des achats et des ventes	Total des achats et des ventes (en milliers)	% du Total des achats et des ventes
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	$ 22 258 882	32,25	$ 7 611 856	19,11
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	730 951	15,06	318 589	10,42
Fonds Commodity Real Return Fund	3 040 615	4,33	1 137 728	2,70
Fonds Diversified Income Fund	17 399 378	4,21	11 383 813	2,83
Fonds Emerging Local Bond Fund	1 659 744	2,12	3 857 507	5,00
Fonds Emerging Markets Bond Fund	3 169 131	7,60	1 724 699	5,25
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	74 306	4,64	83 567	4,29
Fonds Global Bond Fund	9 557 901	1,81	7 593 412	1,63
Fonds Global High Yield Bond Fund	4 538 756	6,31	1 186 592	2,05
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	3 450 967	2,04	4 221 083	1,35
Fonds Global Real Return Fund	1 300 718	1,03	2 790 010	1,76
Fonds Income Fund	349 874 783	11,02	31 143 041	1,62
Fonds Income Fund II	644	0,07	2 799	0,42
Fonds Low Average Duration Fund	2 519 168	3,60	319 689	1,56
Fonds Total Return Bond Fund	9 037 904	5,40	1 717 179	1,39
Fonds US High Yield Bond Fund	5 136 959	14,37	1 135 147	5,59

Aucune commission n'a été prélevée sur les transactions du tableau ci-dessus pour les exercices clos les 31 décembre 2022 et 31 décembre 2021.

Les actions détenues dans des Fonds agréés par la SFC par les Administrateurs de la Société pour les exercices clos le 31 décembre 2022 et le 31 décembre 2021 sont détaillées dans la Note 14. Les commissions versées aux Administrateurs de la Société pour les exercices clos le 31 décembre 2022 et le 31 décembre 2021 sont détaillées dans la Note 13.

La valeur des actions en circulation détenues par des Personnes liées du Gestionnaire, des Conseillers en investissement et/ou des Conseillers en investissement par délégation au-delà de 20 % de l'actif net des Fonds agréés par la SFC au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 est détaillée dans la Note 14. Les commissions versées au Gestionnaire, aux Conseillers en investissement et/ou aux Conseillers en investissement par délégation sont détaillées dans la Note 13 et dans le Compte de résultat.

Les Administrateurs et Dirigeants du Dépositaire ne détenaient aucune action dans les Fonds agréés par la SFC pour les exercices clos le 31 décembre 2022 et le 31 décembre 2021. Comme indiqué à la Note 13, les commissions et frais du Dépositaire sont payés par le Gestionnaire à partir des Frais de gestion ou par les Conseillers en investissement. Comme indiqué à la Note 4, tous les avoirs en banque des Fonds agréés par la SFC sont détenus soit par State Street Bank and Trust Co., en tant qu'agent du Dépositaire, soit directement auprès d'un sous-dépositaire. Le Dépositaire peut verser ou facturer des intérêts aux Fonds agréés par la SFC sur ces soldes de trésorerie.

18. CAPITAL SOCIAL

(a) Actions autorisées

Le capital social autorisé de la Société est de 38 092 EUR divisé en 30 000 actions de souscripteur à 1,27 EUR chacune et 500 000 000 000 d'actions de participation sans valeur nominale initialement désignées comme actions non classées.

(b) Actions de souscripteur

L'ensemble des 30 000 actions de souscripteur initiales ont été rachetées, sauf sept. Les actions de souscripteur ne font pas partie de la Valeur Nette d'Inventaire de la Société et, de ce fait, sont déclarées dans les états financiers, au titre exclusif de cette note. De l'avis du Conseil, cette information témoigne de la nature de l'activité de la Société en tant que fonds d'investissement.

(c) Actions de participation rachetables

Le capital social participatif émis est toujours égal à la Valeur Nette d'Inventaire des Fonds. Les actions de participation rachetables sont rachetables sur option des actionnaires et sont classées comme passifs financiers. La variation du nombre d'actions de participation pour les exercices clos les 31 décembre 2022 et 31 décembre 2021 était comme suit (en milliers) :

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	147 409	125 307
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(90 909)	(30 398)
	56 500	94 909
Distribution		
Émises	2 322	27 748
Émises à partir du réinvestissement des distributions	26	18
Rachetées au cours de l'exercice	(14 441)	(3 804)
	(12 093)	23 962
Institutions en AUD (couverte) :		
Distribution		
Émises	26 623	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1 749	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	0
	28 371	1
Institutions en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	56	3 788
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 326)	(577)
	(3 270)	3 211
Distribution		
Émises	64	580
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(374)	(72)
	(310)	508
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	42 800	78 754
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(49 261)	(12 216)
	(6 461)	66 538
Distribution		
Émises	10 911	9 985
Émises à partir du réinvestissement des distributions	50	0
Rachetées au cours de l'exercice	(15 600)	(2 410)
	(4 639)	7 575
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	942	2 205
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 102)	(209)
	(160)	1 996
Distribution		
Émises	1 996	9 212
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	(5 990)	(2 152)
	(3 993)	7 061

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (suite)	
Institutions en RMB (couverte) :		
Distribution		
Émises	0	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	0
	(1)	1
Institutions en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	52	9
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	0
Rachetées au cours de l'exercice	(9)	0
	44	9
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	471	2 262
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 508)	(61)
	(1 037)	2 201
Distribution		
Émises	1 782	29 267
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(23 044)	(4 207)
	(21 262)	25 060
Investisseurs en AUD (couverte) :		
Distribution		
Émises	14	542
Émises à partir du réinvestissement des distributions	3	2
Rachetées au cours de l'exercice	(39)	0
	(22)	544
Investisseurs en EUR (couverte) :		
Distribution		
Émises	36	85
Émises à partir du réinvestissement des distributions	4	3
Rachetées au cours de l'exercice	(20)	0
	20	88
Investisseurs en RMB (couverte) :		
Distribution		
Émises	0	193
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	(94)	0
	(93)	194
Investisseurs en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	94	746
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(256)	(108)
	(162)	638
Administrations :		
Distribution		
Émises	1 522	6 792
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 214)	(3 895)
	(692)	2 897
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	2 822	8 784
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 457)	(1 233)
	(635)	7 551

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (suite)	
Distribution		
Émises	1 198	10 389
Émises à partir du réinvestissement des distributions	74	48
Rachetées au cours de l'exercice	(4 616)	(1 552)
	(3 344)	8 885
Catégorie E en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	143	140
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(148)	(11)
	(5)	129
Distribution		
Émises	4	29
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	4	29
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 933	6 849
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 255)	(2 100)
	(322)	4 749
Distribution		
Émises	384	1 241
Émises à partir du réinvestissement des distributions	12	5
Rachetées au cours de l'exercice	(333)	(191)
	63	1 055
Catégorie E en HKD (non couverte) :		
Distribution		
Émises	408	3 909
Émises à partir du réinvestissement des distributions	3	2
Rachetées au cours de l'exercice	(30)	(3 634)
	381	277
Catégorie E en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	283	2 097
Émises à partir du réinvestissement des distributions	26	22
Rachetées au cours de l'exercice	(1 065)	(406)
	(756)	1 713
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	152	46
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	(26)
	152	20
Distribution		
Émises	0	934
Émises à partir du réinvestissement des distributions	5	19
Rachetées au cours de l'exercice	(6)	(873)
	(1)	80
M Détail :		
Distribution II		
Émises	403	1 877
Émises à partir du réinvestissement des distributions	27	20
Rachetées au cours de l'exercice	(477)	(432)
	(47)	1 465
M Détail en HKD (non couverte) :		
Distribution II		
Émises	339	723
Émises à partir du réinvestissement des distributions	2	3
Rachetées au cours de l'exercice	(842)	(112)
	(501)	614
M Détail en SGD (couverte) :		
Distribution II		
Émises	43	788
Émises à partir du réinvestissement des distributions	16	11
Rachetées au cours de l'exercice	(89)	(135)
	(30)	664
Catégorie Z :		
Capitalisation		
Émises	1 622	2 405
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4 918)	(2 948)
	(3 296)	(543)
	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	
Institutions :		
Distribution		
Émises	6 037	7 171
Émises à partir du réinvestissement des distributions	90	7
Rachetées au cours de l'exercice	(6 309)	(582)
	(182)	6 596
Institutions en EUR (couverte) :		
Distribution		
Émises	4 068	12 724
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 641)	(1 656)
	1 427	11 068
Institutions en GBP (couverte) :		
Distribution		
Émises	6	19
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	7	19
Institutions en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	2	158
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(101)	(4)
	(99)	154
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	97	35
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4)	(35)
	93	0
Distribution		
Émises	1 119	1 467
Émises à partir du réinvestissement des distributions	3	3
Rachetées au cours de l'exercice	(687)	(1 060)
	435	410
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	217	546
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(69)	(14)
	148	532

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (suite)		
Catégorie E en EUR (non couverte) : Capitalisation		
Émises	146	1 066
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(349)	(339)
	(203)	727
Catégorie E en HKD (non couverte) : Distribution		
Émises	0	351
Émises à partir du réinvestissement des distributions	5	3
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	5	354
Catégorie E en SGD (couverte) : Distribution		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	1	1
M Détail en HKD (non couverte) : Distribution		
Émises	66	589
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(432)	(1 347)
	(366)	(758)
Catégorie Z : Capitalisation		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(609)	(1)
	(609)	(1)
Fonds PIMCO Capital Securities Fund		
Institutions : Capitalisation		
Émises	26 728	64 372
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(61 431)	(54 821)
	(34 703)	9 551
Distribution		
Émises	7 801	32 356
Émises à partir du réinvestissement des distributions	18	16
Rachetées au cours de l'exercice	(30 396)	(7 962)
	(22 577)	24 410
Institutions en AUD (couverte) : Distribution		
Émises	0	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	0
	(1)	1
Institutions en BRL (couverte) : Capitalisation		
Émises	626	5 434
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 441)	(658)
	(2 815)	4 776

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)		
Institutions en CHF (couverte) : Capitalisation		
Émises	862	5 244
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4 292)	(1 400)
	(3 430)	3 844
Institutions en EUR (couverte) : Capitalisation		
Émises	40 278	70 147
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(71 053)	(61 487)
	(30 775)	8 660
Distribution		
Émises	796	6 944
Émises à partir du réinvestissement des distributions	20	6
Rachetées au cours de l'exercice	(2 261)	(7 772)
	(1 445)	(822)
Distribution II		
Émises	134	1 843
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(489)	(269)
	(355)	1 574
Institutions en GBP (couverte) : Capitalisation		
Émises	743	1 214
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(921)	(973)
	(178)	241
Distribution		
Émises	1 859	3 221
Émises à partir du réinvestissement des distributions	6	39
Rachetées au cours de l'exercice	(3 868)	(4 998)
	(2 003)	(1 738)
Institutions en RMB (couverte) : Distribution		
Émises	0	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	0
	(1)	1
Institutions en SGD (couverte) : Distribution		
Émises	17	6
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	(2)
	17	4
Investisseurs : Capitalisation		
Émises	1 648	10 726
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(8 354)	(4 328)
	(6 706)	6 398
Distribution		
Émises	1 282	8 050
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(15 075)	(4 600)
	(13 793)	3 450

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)		
Investisseurs en AUD (couverte) :		
Distribution		
Émises	1 565	151
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 624)	(122)
	(1 059)	29
Investisseurs en CAD (couverte) :		
Distribution		
Émises	0	380
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	1	381
Investisseurs en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	397	1 174
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 020)	(421)
	(1 623)	753
Investisseurs en GBP (couverte) :		
Distribution		
Émises	61	192
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(86)	(59)
	(25)	133
Investisseurs en RMB (couverte) :		
Distribution		
Émises	0	95
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(17)	(92)
	(17)	3
Investisseurs en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	320	113
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(174)	(67)
	146	46
Administrations :		
Capitalisation		
Émises	2 926	2 064
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 384)	(4 581)
	542	(2 517)
Distribution		
Émises	527	2 650
Émises à partir du réinvestissement des distributions	13	2
Rachetées au cours de l'exercice	(2 116)	(2 612)
	(1 576)	40
Distribution II		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Administrations en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	62	173
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(243)	(299)
	(181)	(126)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)		
Administrations en SGD (couverte) :		
Distribution II		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	4 440	11 374
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(7 660)	(9 488)
	(3 220)	1 886
Distribution		
Émises	1 173	3 409
Émises à partir du réinvestissement des distributions	15	24
Rachetées au cours de l'exercice	(3 171)	(2 320)
	(1 983)	1 113
Catégorie E en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	100	223
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(247)	(79)
	(147)	144
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	4 671	10 196
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(6 757)	(8 929)
	(2 086)	1 267
Distribution		
Émises	1 329	2 340
Émises à partir du réinvestissement des distributions	2	1
Rachetées au cours de l'exercice	(1 068)	(1 418)
	263	923
M Détail :		
Distribution II		
Émises	6 498	15 117
Émises à partir du réinvestissement des distributions	43	21
Rachetées au cours de l'exercice	(10 686)	(6 859)
	(4 145)	8 279
M Détail en HKD (non couverte) :		
Distribution		
Émises	0	63
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 913)	0
	(1 913)	63
M Détail en SGD (couverte) :		
Distribution II		
Émises	2 290	8 570
Émises à partir du réinvestissement des distributions	23	13
Rachetées au cours de l'exercice	(4 641)	(1 135)
	(2 328)	7 448
Catégorie R :		
Distribution		
Émises	64	95
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(89)	(83)
	(25)	12

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)	
Catégorie R en EUR (couverte) : Distribution		
Émises	23	679
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(811)	(416)
	(788)	263
Catégorie R en GBP (couverte) : Distribution		
Émises	29	49
Émises à partir du réinvestissement des distributions	2	6
Rachetées au cours de l'exercice	(280)	(94)
	(249)	(39)
Catégorie T : Distribution		
Émises	199	284
Émises à partir du réinvestissement des distributions	7	5
Rachetées au cours de l'exercice	(333)	(256)
	(127)	33
Catégorie T en EUR (couverte) : Capitalisation		
Émises	641	2 313
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 335)	(1 186)
	(694)	1 127
Catégorie Z : Distribution		
Émises	95	4 184
Émises à partir du réinvestissement des distributions	463	308
Rachetées au cours de l'exercice	(3 061)	(495)
	(2 503)	3 997
Catégorie Z en AUD (couverte) : Distribution		
Émises	1 779	2 551
Émises à partir du réinvestissement des distributions	578	458
Rachetées au cours de l'exercice	(2 578)	(2 967)
	(221)	42
	Fonds PIMCO Climate Bond Fund	
Institutions : Capitalisation		
Émises	1 367	1 726
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(359)	(67)
	1 008	1 659
Institutions en CHF (couverte) : Capitalisation		
Émises	7	89
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(6)	(1)
	1	88
Institutions en EUR (couverte) : Capitalisation		
Émises	4 564	8 199
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(5 279)	(1 779)
	(715)	6 420
Distribution		
Émises	154	4 381
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 564)	(12)
	(1 410)	4 369

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds PIMCO Climate Bond Fund (suite)	
Institutions en GBP (couverte) : Capitalisation		
Émises	1 673	3 175
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(752)	(545)
	921	2 630
Distribution		
Émises	4 497	85
Émises à partir du réinvestissement des distributions	11	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 602)	(13)
	2 906	72
Institutions en SEK (couverte) : Capitalisation		
Émises	496	2 939
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(29)	0
	467	2 939
Institutions en SGD (couverte) : Capitalisation		
Émises	203	626
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(109)	(85)
	94	541
Investisseurs : Capitalisation		
Émises	5	321
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(326)	0
	(321)	321
Investisseurs en EUR (couverte) : Capitalisation		
Émises	0	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	0
	(1)	1
Administrations en SEK (couverte) : Capitalisation		
Émises	0	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	0	1
Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation		
Émises	629	1 976
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(438)	(308)
	191	1 668
Catégorie Z : Capitalisation		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	0	0
	Fonds Commodity Real Return Fund	
Institutions : Capitalisation		
Émises	40 486	63 143
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(66 747)	(20 339)
	(26 261)	42 804

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Commodity Real Return Fund (suite)	
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	27 911	21 162
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(20 593)	(9 207)
	7 318	11 955
Institutions en EUR (non couverte) :		
Capitalisation		
Émises	3 509	4 815
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 319)	(478)
	2 190	4 337
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	2 237	1 894
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 286)	(479)
	(49)	1 415
Institutions en GBP (non couverte) :		
Distribution		
Émises	1 888	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	(7)	S/O
	1 881	S/O
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	5 082	8 596
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(7 606)	(1 901)
	(2 524)	6 695
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	25 761	32 792
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(28 579)	(8 651)
	(2 818)	24 141
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	38 450	38 799
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(40 323)	(7 876)
	(1 873)	30 923
Catégorie E en SGD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 644	34
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 495)	0
	149	34
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	428	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	S/O
	427	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	191	449
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(218)	(412)
	(27)	37
Institutions en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(560)	(24)
	(560)	(24)
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	235	385
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 059)	(569)
	(1 824)	(184)
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	231	439
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(259)	(334)
	(28)	105
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	65	434
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(248)	(355)
	(183)	79
	Fonds Diversified Income Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	3 884	20 143
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(13 073)	(13 814)
	(9 189)	6 329
Distribution		
Émises	1 885	12 723
Émises à partir du réinvestissement des distributions	574	449
Rachetées au cours de l'exercice	(18 694)	(20 355)
	(16 235)	(7 183)
Institutions en CAD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 524	18 814
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(5 130)	(6 141)
	(3 606)	12 673
Institutions en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	212	638
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(284)	(589)
	(72)	49
Distribution		
Émises	193	230
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(494)	(832)
	(301)	(602)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Diversified Income Fund (suite)	
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	15 813	42 609
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(41 537)	(41 453)
	(25 724)	1 156
Distribution		
Émises	25 908	22 120
Émises à partir du réinvestissement des distributions	342	312
Rachetées au cours de l'exercice	(69 909)	(26 928)
	(43 659)	(4 496)
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 458	22 532
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(37 733)	(46 646)
	(36 275)	(24 114)
Distribution		
Émises	16 091	46 897
Émises à partir du réinvestissement des distributions	512	502
Rachetées au cours de l'exercice	(30 848)	(99 522)
	(14 245)	(52 123)
Institutions en MXN (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	3 007	2 778
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 975)	0
	32	2 778
Institutions en SEK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1	17
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	(285)
	1	(268)
Institutions en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	1 322	7 284
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	2
Rachetées au cours de l'exercice	(3 829)	(2 359)
	(2 507)	4 927
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	1 949	2 281
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 263)	(915)
	(1 314)	1 366
Distribution		
Émises	9 350	4 515
Émises à partir du réinvestissement des distributions	16	19
Rachetées au cours de l'exercice	(5 393)	(1 998)
	3 973	2 536
Investisseurs en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	177	1 193
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(660)	(851)
	(483)	342

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Diversified Income Fund (suite)	
Distribution		
Émises	317	472
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(202)	(117)
	115	355
Administrations :		
Distribution		
Émises	1 604	5 187
Émises à partir du réinvestissement des distributions	25	25
Rachetées au cours de l'exercice	(4 583)	(4 950)
	(2 954)	262
Administrations en AUD (couverte) :		
Distribution		
Émises	14	153
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	1
Rachetées au cours de l'exercice	(43)	(197)
	(29)	(43)
Administrations en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	46	110
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(315)	(242)
	(269)	(132)
Administrations en GBP (couverte) :		
Distribution		
Émises	50	494
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(246)	(374)
	(196)	120
Administrations en JPY (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	391	47
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	391	47
Administrations en SEK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	0	0
Administrations en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	640	6 067
Émises à partir du réinvestissement des distributions	23	18
Rachetées au cours de l'exercice	(3 780)	(9 019)
	(3 117)	(2 934)
BM Détail :		
Distribution II		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
BN Détail :		
Distribution II		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Diversified Income Fund (suite)	
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	4 099	15 575
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(17 311)	(29 090)
	(13 212)	(13 515)
Distribution		
Émises	5 389	14 608
Émises à partir du réinvestissement des distributions	93	87
Rachetées au cours de l'exercice	(17 485)	(25 632)
	(12 003)	(10 937)
Catégorie E en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	65	416
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(86)	(198)
	(21)	218
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	15 932	40 481
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(33 142)	(33 558)
	(17 210)	6 923
Distribution		
Émises	4 672	17 811
Émises à partir du réinvestissement des distributions	2	3
Rachetées au cours de l'exercice	(37 797)	(36 241)
	(33 123)	(18 427)
Catégorie E en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	22	2 333
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 940)	(5 636)
	(1 917)	(3 303)
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	17 461	27 554
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(66 418)	(18 300)
	(48 957)	9 254
Distribution		
Émises	13	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	0
	12	0
M Détail :		
Distribution		
Émises	1 664	5 152
Émises à partir du réinvestissement des distributions	38	52
Rachetées au cours de l'exercice	(6 706)	(12 877)
	(5 004)	(7 673)
Distribution II		
Émises	9 583	20 918
Émises à partir du réinvestissement des distributions	2	19
Rachetées au cours de l'exercice	(17 798)	(33 216)
	(8 213)	(12 279)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Diversified Income Fund (suite)	
M Détail en AUD (couverte) :		
Distribution		
Émises	942	1 690
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	4
Rachetées au cours de l'exercice	(2 811)	(7 103)
	(1 868)	(5 409)
M Détail en SGD (couverte) :		
Distribution II		
Émises	0	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	0
	(1)	1
N Détail :		
Distribution II		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	0	0
Catégorie T :		
Capitalisation		
Émises	175	1 980
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(943)	(1 276)
	(768)	704
Distribution		
Émises	44	271
Émises à partir du réinvestissement des distributions	5	3
Rachetées au cours de l'exercice	(154)	(215)
	(105)	59
Catégorie T en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	337	1 306
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 070)	(1 442)
	(733)	(136)
Distribution		
Émises	129	449
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(490)	(1 012)
	(361)	(563)
Catégorie W :		
Capitalisation		
Émises	1 342	8 978
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(5 541)	(1 852)
	(4 199)	7 126
Distribution		
Émises	393	13 392
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(8 527)	(3 141)
	(8 134)	10 251
Catégorie W en CAD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	0
	(1)	0

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Diversified Income Fund (suite)		
Catégorie W en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	456	544
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(478)	(434)
	(22)	110
Distribution		
Émises	82	161
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(153)	0
	(71)	161
Catégorie W en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	607	706
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(675)	(246)
	(68)	460
Distribution		
Émises	146	254
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(393)	(325)
	(247)	(71)
Catégorie W en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	82	301
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(68)	(112)
	14	189
Distribution		
Émises	109	313
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(100)	(30)
	9	283
Catégorie W en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	165	500
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(257)	(353)
	(92)	147

	Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	129	4 012
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 800)	(1 797)
	(2 671)	2 215
Distribution		
Émises	0	132
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(326)	(18)
	(326)	114
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	2 538	7 118
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(7 903)	(2 109)
	(5 365)	5 009

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)		
Distribution II		
Émises	22	1 046
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 662)	(1 079)
	(3 640)	(33)
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	272	2 889
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(8 534)	(12 541)
	(8 262)	(9 652)
Distribution		
Émises	92	593
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(12 053)	(7 348)
	(11 961)	(6 755)
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	4	1 278
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(454)	(1 280)
	(450)	(2)
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	632	1 935
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 383)	(1 275)
	(1 751)	660
Distribution		
Émises	436	1 927
Émises à partir du réinvestissement des distributions	4	2
Rachetées au cours de l'exercice	(669)	(906)
	(229)	1 023
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 162	9 045
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(11 254)	(9 193)
	(10 092)	(148)
Distribution		
Émises	99	324
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 054)	(1 536)
	(955)	(1 212)

	Fonds Diversified Income ESG Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	947	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	947	S/O
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	23	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	23	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Diversified Income ESG Fund (suite)		
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	19	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	19	S/O
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Fonds Dynamic Bond Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	3 696	16 167
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(11 498)	(9 947)
	(7 802)	6 220
Distribution		
Émises	229	10 029
Émises à partir du réinvestissement des distributions	3	1
Rachetées au cours de l'exercice	(1 057)	(5 577)
	(825)	4 453
Institutions en CAD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(212)	(238)
	(212)	(237)
Institutions en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 034	1 764
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 834)	(339)
	(800)	1 425
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	11 147	22 189
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(21 791)	(30 976)
	(10 644)	(8 787)
Distribution		
Émises	570	428
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(559)	(130)
	11	298
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	100 815	25 423
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(15 420)	(20 841)
	85 395	4 582

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Dynamic Bond Fund (suite)		
Distribution		
Émises	1 066	4 284
Émises à partir du réinvestissement des distributions	56	66
Rachetées au cours de l'exercice	(16 302)	(2 771)
	(15 180)	1 579
Institutions en NOK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	6	18
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(9 634)	(481)
	(9 628)	(463)
Institutions en SEK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1	126
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(238)	(4 650)
	(237)	(4 524)
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	483	1 586
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(951)	(1 248)
	(468)	338
Distribution		
Émises	11	378
Émises à partir du réinvestissement des distributions	6	4
Rachetées au cours de l'exercice	(94)	(285)
	(77)	97
Investisseurs en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	573
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(312)	(359)
	(312)	214
Administrations :		
Capitalisation		
Émises	61	297
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(530)	(411)
	(469)	(114)
Administrations en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	7	161
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(197)	(245)
	(190)	(84)
Administrations en SEK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	18	20
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(139)	(140)
	(121)	(120)
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	1 408	3 663
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 734)	(2 075)
	(1 326)	1 588

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Dynamic Bond Fund (suite)	
Distribution		
Émises	218	493
Émises à partir du réinvestissement des distributions	8	4
Rachetées au cours de l'exercice	(473)	(501)
	(247)	(4)
Catégorie E en CHF (couverte) : Capitalisation		
Émises	99	72
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(177)	(158)
	(78)	(86)
Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation		
Émises	412	9 438
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(5 226)	(6 436)
	(4 814)	3 002
Catégorie E en GBP (couverte) : Capitalisation		
Émises	21	52
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(31)	(60)
	(10)	(8)
G Détail en EUR (couverte) : Distribution		
Émises	12	56
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(108)	(238)
	(96)	(182)
H Institutions : Capitalisation		
Émises	730	2 355
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 272)	(1 118)
	(542)	1 237
Distribution		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	0	0
Catégorie R : Capitalisation		
Émises	38	87
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(103)	(134)
	(65)	(47)
Catégorie Z : Capitalisation		
Émises	0	1 001
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(276)	0
	(276)	1 001
Catégorie Z en AUD (couverte) : Distribution		
Émises	145	683
Émises à partir du réinvestissement des distributions	101	92
Rachetées au cours de l'exercice	(821)	(538)
	(575)	237

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	
Institutions : Capitalisation		
Émises	16 762	105 022
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(78 040)	(59 899)
	(61 278)	45 123
Distribution II		
Émises	971	4 840
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4 764)	(5 591)
	(3 793)	(751)
Institutions en CHF (couverte) : Capitalisation		
Émises	4	183
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(145)	(118)
	(141)	65
Institutions en GBP (couverte) : Capitalisation		
Émises	13 616	29 871
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(9 604)	(5 172)
	4 012	24 699
Distribution		
Émises	2 347	1 304
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(659)	(15)
	1 688	1 289
Institutions en ILS (couverte) : Capitalisation		
Émises	423	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	423	S/O
Institutions en SGD (couverte) : Capitalisation		
Émises	9 784	2 702
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	9 784	2 702
Institutions en USD (couverte) : Capitalisation		
Émises	2 374	13 743
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(9 023)	(7 054)
	(6 649)	6 689
Distribution II		
Émises	20	512
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	0
	19	512
Investisseurs : Capitalisation		
Émises	131	461
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4)	(37)
	127	424

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Dynamic Multi-Asset Fund (suite)	
Investisseurs en USD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	0	1
BM Détail en AUD (couverte) :		
Distribution II		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
BM Détail en USD (couverte) :		
Distribution II		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	17 931	148 575
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(71 978)	(73 501)
	(54 047)	75 074
Distribution		
Émises	67	585
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(78)	(165)
	(11)	420
Catégorie E en USD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	2 719	25 775
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(6 818)	(14 814)
	(4 099)	10 961
Distribution		
Émises	3	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	3	1
Distribution II		
Émises	0	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	0	1
H Institutions en USD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 976	4 628
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 546)	(10 316)
	(570)	(5 688)
M Détail en AUD (couverte) :		
Distribution II		
Émises	13	65
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	(32)	(9)
	(18)	57

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Dynamic Multi-Asset Fund (suite)	
M Détail en SGD (couverte) :		
Distribution II		
Émises	93	3 755
Émises à partir du réinvestissement des distributions	6	4
Rachetées au cours de l'exercice	(234)	(2 120)
	(135)	1 639
M Détail en USD (couverte) :		
Distribution II		
Émises	1 806	13 972
Émises à partir du réinvestissement des distributions	5	6
Rachetées au cours de l'exercice	(5 705)	(10 358)
	(3 894)	3 620
Catégorie T :		
Capitalisation		
Émises	616	7 194
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 236)	(2 049)
	(1 620)	5 145
Catégorie T en USD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	349	63
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(13)	0
	336	63
Catégorie Z :		
Capitalisation		
Émises	17	10 201
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 434)	(951)
	(1 417)	9 250
	Fonds Emerging Local Bond Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	44 501	56 697
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(46 912)	(84 013)
	(2 411)	(27 316)
Distribution		
Émises	152	1 474
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(456)	(2 209)
	(304)	(735)
Institutions en CHF (non couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(44)	(7)
	(44)	(7)
Institutions en EUR (non couverte) :		
Capitalisation		
Émises	7 070	13 694
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(12 977)	(7 064)
	(5 907)	6 630
Distribution		
Émises	6 133	8 745
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 859)	(30 055)
	2 274	(21 310)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)	
Institutions en GBP (non couverte) :		
Capitalisation		
Émises	141	13
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(78)	(30)
	63	(17)
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	232	1 946
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 010)	(326)
	(1 778)	1 620
Investisseurs en EUR (non couverte) :		
Capitalisation		
Émises	21	6
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(276)	(1)
	(255)	5
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	2 431	601
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 501)	(1 352)
	(70)	(751)
Distribution		
Émises	191	240
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	2
Rachetées au cours de l'exercice	(418)	(762)
	(226)	(520)
Catégorie E en EUR (non couverte) :		
Capitalisation		
Émises	625	939
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 405)	(2 554)
	(780)	(1 615)
Distribution		
Émises	7	3
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(28)	(16)
	(21)	(13)
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	5 708	597
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(293)	(596)
	5 415	1
Catégorie Z :		
Distribution		
Émises	0	2 561
Émises à partir du réinvestissement des distributions	277	227
Rachetées au cours de l'exercice	0	(178)
	277	2 610
	Fonds Emerging local Bond ESG Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	489	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	489	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (suite)	
Distribution		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Institutions en EUR (non couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Distribution		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Distribution		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Investisseurs en EUR (non couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Distribution		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Distribution		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Catégorie E en EUR (non couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Distribution		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Emerging Local Bond ESG Fund (suite)		
Catégorie Z :		
Capitalisation		
Émises	123	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	123	S/O
Fonds Emerging Markets Bond Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	10 925	13 727
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(15 619)	(18 027)
	(4 694)	(4 300)
Distribution		
Émises	688	3 350
Émises à partir du réinvestissement des distributions	85	75
Rachetées au cours de l'exercice	(1 874)	(2 448)
	(1 101)	977
Institutions en CHF (couverte) :		
Distribution		
Émises	232	213
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(57)	(18)
	175	195
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	12 568	9 857
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(8 822)	(10 055)
	3 746	(198)
Distribution		
Émises	31 500	55 939
Émises à partir du réinvestissement des distributions	90	87
Rachetées au cours de l'exercice	(68 483)	(40 673)
	(36 893)	15 353
Institutions en EUR (non couverte) :		
Capitalisation		
Émises	5 590	2 721
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(6 467)	(2 712)
	(877)	9
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	235	551
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(160)	(71)
	75	480
Distribution		
Émises	2 143	4 560
Émises à partir du réinvestissement des distributions	133	98
Rachetées au cours de l'exercice	(3 367)	(9 388)
	(1 091)	(4 730)
Institutions en PLN (couverte) :		
Distribution		
Émises	0	9 925
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	2
Rachetées au cours de l'exercice	(9 928)	0
	(9 927)	9 927

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)		
Institutions en SGD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 303	2 117
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(828)	(754)
	475	1 363
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	7	33
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(54)	(38)
	(47)	(5)
Investisseurs en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	17
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(8)	(1)
	(8)	16
Administrations :		
Capitalisation		
Émises	82	167
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(215)	(144)
	(133)	23
BM Détail :		
Distribution II		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	847	1 400
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 406)	(1 701)
	(559)	(301)
Distribution		
Émises	7 933	12 615
Émises à partir du réinvestissement des distributions	12	28
Rachetées au cours de l'exercice	(10 704)	(15 526)
	(2 759)	(2 883)
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	541	1 493
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 372)	(1 497)
	(831)	(4)
Catégorie E en SGD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	79	64
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(70)	(75)
	9	(11)
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	7 545	5 633
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(6 018)	(7 656)
	1 527	(2 023)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)		
Distribution		
Émises	0	28
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	0	28
M Détail :		
Distribution		
Émises	112	530
Émises à partir du réinvestissement des distributions	5	10
Rachetées au cours de l'exercice	(246)	(705)
	(129)	(165)
Distribution II		
Émises	16 994	16 287
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	2
Rachetées au cours de l'exercice	(16 949)	(16 554)
	45	(265)
M Détail en AUD (couverte) :		
Distribution		
Émises	12	615
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	2
Rachetées au cours de l'exercice	(587)	(769)
	(575)	(152)
Catégorie Z :		
Distribution		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	31	25
Rachetées au cours de l'exercice	0	(2)
	31	23
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	19 358	18 751
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(11 060)	(8 390)
	8 298	10 361
Distribution		
Émises	13 168	30 080
Émises à partir du réinvestissement des distributions	178	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 833)	(720)
	9 513	29 360
Institutions en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 769	5 067
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(11)	0
	1 758	5 067
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	56 354	60 012
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(32 858)	(23 346)
	23 496	36 666
Distribution		
Émises	30 800	26 606
Émises à partir du réinvestissement des distributions	114	3
Rachetées au cours de l'exercice	(32 730)	(16 503)
	(1 816)	10 106

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (suite)		
Institutions en GBP (couverte) :		
Distribution		
Émises	16 488	8 744
Émises à partir du réinvestissement des distributions	2	1
Rachetées au cours de l'exercice	(2 491)	(607)
	13 999	8 138
Institutions en GBP (non couverte) :		
Distribution		
Émises	239	410
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(138)	(13)
	101	397
Investisseurs en NOK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	(8)
	0	(8)
Investisseurs en SEK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	308	38
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(105)	(49)
	203	(11)
Administrations :		
Capitalisation		
Émises	0	42
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(22)	(85)
	(22)	(43)
Distribution		
Émises	0	74
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(6)	(1)
	(6)	73
Administrations en SEK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	4	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4)	0
	0	1
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	27	172
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(65)	(14)
	(38)	158
Distribution		
Émises	32	104
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(30)	(12)
	2	92
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	4 801	14 828
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(9 874)	(10 227)
	(5 073)	4 601

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	792	1 234
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(789)	(1 830)
	3	(596)
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	814	588
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(325)	(1 362)
	489	(774)
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	192	329
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(518)	(268)
	(326)	61
Catégorie E en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	2	20
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(189)	(195)
	(187)	(175)
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	59	264
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(352)	(521)
	(293)	(257)
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	2 229	3 974
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4 163)	(805)
	(1 934)	3 169
Institutions en EUR (partiellement couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 044	8 768
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(13 456)	(4 238)
	(12 412)	4 530
Institutions en GBP (partiellement couverte) :		
Distribution		
Émises	79	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	2	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	81	S/O
Catégorie E en EUR (partiellement couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		
Catégorie Z :		
Capitalisation		
Émises	13 622	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	(3 520)	S/O
	10 102	S/O
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	0	151
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(8)	(153)
	(8)	(2)
Institutions en EUR (non couverte) :		
Capitalisation		
Émises	451	1 460
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(757)	(1 255)
	(306)	205
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	36	27
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(82)	(84)
	(46)	(57)
Catégorie E en EUR (non couverte) :		
Capitalisation		
Émises	63	42
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(215)	(316)
	(152)	(274)
Fonds PIMCO ESG Income Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	2 231	547
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(286)	(6)
	1 945	541
Distribution		
Émises	8	372
Émises à partir du réinvestissement des distributions	10	3
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	18	375
Institutions en AUD (couverte) :		
Distribution		
Émises	6 278	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	59	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	6 337	1
Institutions en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	735	70
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	(1)
	734	69

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite)		
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	7 700	7 363
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 366)	(188)
	4 334	7 175
Distribution		
Émises	237	22
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(42)	0
	195	22
Institutions en GBP (couverte) :		
Distribution		
Émises	3	64
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(7)	(16)
	(4)	48
Institutions en SEK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	563	772
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	563	772
Institutions en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	3	36
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	4	36
Administrations en SEK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	826	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	(10)	S/O
	816	S/O
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	176	29
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(49)	(1)
	127	28
Distribution		
Émises	44	2
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3)	0
	41	2
Catégorie E en CHF (couverte) :		
Distribution		
Émises	0	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	0	1
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	522	112
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(99)	0
	423	112

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite)		
Distribution		
Émises	94	26
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(5)	0
	89	26
Catégorie R en AUD (couverte) :		
Distribution		
Émises	556	3 171
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	(198)
	557	2 973
Fonds Euro Bond Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	11 908	18 290
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(21 387)	(27 142)
	(9 479)	(8 852)
Distribution		
Émises	651	617
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 169)	(16 561)
	(518)	(15 944)
Institutions en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	901	1 598
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(59)	(52)
	842	1 546
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	85	132
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(200)	(700)
	(115)	(568)
Distribution		
Émises	0	2
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(15)	(27)
	(15)	(25)
Administrations :		
Capitalisation		
Émises	0	8
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(110)	(113)
	(110)	(105)
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	486	1 000
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 701)	(4 534)
	(1 215)	(3 534)
Distribution		
Émises	120	393
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(929)	(1 843)
	(809)	(1 450)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Euro Credit Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	14 117	19 199
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(33 114)	(25 134)
	(18 997)	(5 935)
Distribution II		
Émises	9 070	9 324
Émises à partir du réinvestissement des distributions	34	42
Rachetées au cours de l'exercice	(14 528)	(11 894)
	(5 424)	(2 528)
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	47	206
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(399)	(655)
	(352)	(449)
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	12 991	2 699
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 658)	(912)
	10 333	1 787
Distribution II		
Émises	1	5
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(167)	(150)
	(166)	(145)
Fonds Euro Income Bond Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	8 116	31 776
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(40 863)	(31 035)
	(32 747)	741
Distribution		
Émises	25 489	7 884
Émises à partir du réinvestissement des distributions	118	120
Rachetées au cours de l'exercice	(28 907)	(15 642)
	(3 300)	(7 638)
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	31	1 027
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(283)	(254)
	(252)	773
Distribution		
Émises	0	6
Émises à partir du réinvestissement des distributions	2	1
Rachetées au cours de l'exercice	(90)	(806)
	(88)	(799)
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	2 777	6 760
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(19 331)	(34 517)
	(16 554)	(27 757)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Euro Income Bond Fund (suite)		
Distribution		
Émises	1 837	4 464
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	1
Rachetées au cours de l'exercice	(13 945)	(23 249)
	(12 108)	(18 784)
Distribution Q		
Émises	19	88
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(425)	(137)
	(406)	(49)
Catégorie T :		
Capitalisation		
Émises	268	539
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(638)	(1 259)
	(370)	(720)
Distribution		
Émises	122	185
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(370)	(701)
	(248)	(516)
Fonds Euro Long Average Duration Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	1 625	1 886
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 265)	(2 116)
	360	(230)
Fonds Euro Short-Term Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	20 374	17 859
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(43 243)	(32 093)
	(22 869)	(14 234)
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	920	411
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(809)	(851)
	111	(440)
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	3 858	753
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 638)	(512)
	2 220	241
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund (suite)		
Catégorie Z :		
Capitalisation		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(200)	0
	(200)	0
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	5 027	8 555
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(15 856)	(8 576)
	(10 829)	(21)
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	520	77
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(141)	(253)
	379	(176)
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	903	10 698
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(6 802)	(5 348)
	(5 899)	5 350
Fonds Global Advantage Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	36	11
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 084)	(451)
	(1 048)	(440)
Institutions en CHF (partiellement couverte) :		
Distribution		
Émises	0	14
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(336)	0
	(336)	14
Institutions en EUR (partiellement couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 723	3 814
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 551)	(2 407)
	(828)	1 407
Institutions en GBP (partiellement couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	2
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(14)	0
	(14)	2
Institutions en NOK (partiellement couverte) :		
Capitalisation		
Émises	6	631
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	6	631

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Global Advantage Fund (suite)		
Catégorie E en EUR (partiellement couverte) :		
Capitalisation		
Émises	47	35
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(100)	(170)
	(53)	(135)
Fonds Global Bond Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	20 005	25 969
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(24 316)	(45 924)
	(4 311)	(19 955)
Distribution		
Émises	1 853	3 978
Émises à partir du réinvestissement des distributions	52	33
Rachetées au cours de l'exercice	(2 143)	(5 560)
	(238)	(1 549)
Institutions (exposition au risque de change) :		
Capitalisation		
Émises	3 622	3 757
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 873)	(5 657)
	1 749	(1 900)
Distribution		
Émises	29	844
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(127)	(1 514)
	(98)	(670)
Institutions en CAD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	13
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(914)	(917)
	(914)	(904)
Institutions en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 018	3 865
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 240)	(991)
	(1 222)	2 874
Distribution		
Émises	190	1 482
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	(741)	(791)
	(550)	692
Institutions en EUR (exposition au risque de change) :		
Capitalisation		
Émises	10 455	5 748
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(5 337)	(7 680)
	5 118	(1 932)
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	19 257	32 376
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(25 423)	(31 725)
	(6 166)	651

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Global Bond Fund (suite)		
Distribution		
Émises	1 488	1 764
Émises à partir du réinvestissement des distributions	20	11
Rachetées au cours de l'exercice	(2 934)	(7 606)
	(1 426)	(5 831)
Institutions en GBP (exposition au risque de change) : Capitalisation		
Émises	16	51
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(22)	(109)
	(6)	(58)
Institutions en GBP (couverte) : Capitalisation		
Émises	2 464	5 102
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 014)	(3 376)
	(550)	1 726
Distribution		
Émises	2 663	5 061
Émises à partir du réinvestissement des distributions	44	20
Rachetées au cours de l'exercice	(5 377)	(8 951)
	(2 670)	(3 870)
Institutions en ILS (couverte) : Capitalisation		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(18)	(1)
	(18)	(1)
Institutions en NOK (couverte) : Capitalisation		
Émises	1 514	3 659
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4 987)	(917)
	(3 473)	2 742
Institutions en NZD (couverte) : Distribution		
Émises	179	2 427
Émises à partir du réinvestissement des distributions	42	35
Rachetées au cours de l'exercice	(2 702)	(1 049)
	(2 481)	1 413
Institutions en SEK (couverte) : Capitalisation		
Émises	1 489	1 633
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 203)	(1 336)
	286	297
Institutions en SGD (couverte) : Capitalisation		
Émises	4 901	3 846
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 266)	(3 776)
	3 635	70
Investisseurs : Capitalisation		
Émises	654	327
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 502)	(2 036)
	(848)	(1 709)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Global Bond Fund (suite)		
Distribution		
Émises	1 669	50
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	(184)	(159)
	1 486	(108)
Investisseurs (exposition au risque de change) : Capitalisation		
Émises	0	2
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(71)	(89)
	(71)	(87)
Investisseurs en CHF (couverte) : Capitalisation		
Émises	195	465
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 649)	(6 915)
	(1 454)	(6 450)
Investisseurs en EUR (couverte) : Capitalisation		
Émises	410	857
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(603)	(433)
	(193)	424
Investisseurs en GBP (couverte) : Capitalisation		
Émises	25	62
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(9)	(67)
	16	(5)
Investisseurs en NOK (couverte) : Capitalisation		
Émises	22	28
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(30)	(40)
	(8)	(12)
Administrations : Capitalisation		
Émises	255	92
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(413)	(307)
	(158)	(215)
Administrations en SEK (couverte) : Capitalisation		
Émises	1 474	20
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(169)	0
	1 305	20
Catégorie E : Capitalisation		
Émises	2 644	4 275
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(5 612)	(6 673)
	(2 968)	(2 398)
Distribution		
Émises	7 456	1 464
Émises à partir du réinvestissement des distributions	6	6
Rachetées au cours de l'exercice	(7 519)	(6 870)
	(57)	(5 400)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Global Bond Fund (suite)	
Catégorie E (exposition au risque de change) :		
Capitalisation		
Émises	386	838
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 781)	(2 148)
	(1 395)	(1 310)
Distribution		
Émises	256	275
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(306)	(446)
	(50)	(171)
Catégorie E en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	26	25
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(37)	(43)
	(11)	(18)
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	5 158	9 663
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(11 634)	(16 500)
	(6 476)	(6 837)
Distribution		
Émises	741	643
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 225)	(2 315)
	(484)	(1 672)
Catégorie E en NOK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	0
	(1)	1
G Détail en EUR (couverte) :		
Distribution		
Émises	191	1 220
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4 603)	(2 432)
	(4 412)	(1 212)
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	34 334	12 078
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(33 907)	(15 084)
	427	(3 006)
Distribution		
Émises	0	8
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(30)	(122)
	(30)	(114)
H Institutions (exposition au risque de change) :		
Capitalisation		
Émises	71 651	78
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(33 844)	0
	37 807	78

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Global Bond Fund (suite)	
M Détail :		
Distribution II		
Émises	33	21
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(48)	(113)
	(15)	(92)
M Détail en HKD (non couverte) :		
Distribution II		
Émises	0	45
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(227)	(324)
	(227)	(279)
M Détail en SEK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	0
	(1)	1
Catégorie R en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	161	200
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(159)	(87)
	2	113
Catégorie R en SEK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	S/O	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	S/O	0
Rachetées au cours de l'exercice	S/O	(1)
	S/O	(1)
Catégorie T :		
Capitalisation		
Émises	187	333
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(863)	(1 566)
	(676)	(1 233)
Distribution		
Émises	14	34
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	0
Rachetées au cours de l'exercice	(74)	(115)
	(59)	(81)
Catégorie T en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	283	438
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(480)	(959)
	(197)	(521)
Catégorie W :		
Capitalisation		
Émises	1 762	3 255
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 003)	(2 363)
	(241)	892
Distribution		
Émises	645	295
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(458)	(721)
	187	(426)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Global Bond Fund (suite)	
Catégorie W (exposition au risque de change) :		
Capitalisation		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	0
	(1)	0
Distribution		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	0
	(1)	0
Catégorie W en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	502	827
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(970)	(983)
	(468)	(156)
Distribution		
Émises	36	75
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(26)	0
	10	75
Catégorie W en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	805	380
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 199)	(324)
	(394)	56
Distribution		
Émises	159	162
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(107)	(103)
	52	59
Catégorie W en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	206	193
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(64)	(81)
	142	112
Distribution		
Émises	249	90
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(478)	(32)
	(229)	58
Catégorie W en NOK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	8	43
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	(5)
	8	38
Catégorie W en SEK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	0
	(1)	0

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Global Bond ESG Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	19 756	17 719
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(10 249)	(5 282)
	9 507	12 437
Distribution		
Émises	6 056	960
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 272)	(358)
	4 785	602
Institutions en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	51 831	1 018
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4 396)	(437)
	47 435	581
Institutions en EUR (exposition au risque de change) :		
Capitalisation		
Émises	1 418	86
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 060)	0
	358	86
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	71 834	43 699
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(27 284)	(11 160)
	44 550	32 539
Distribution		
Émises	3 526	5 828
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 843)	(10 631)
	(317)	(4 803)
Institutions en GBP (exposition au risque de change) :		
Distribution		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	670	622
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 038)	(252)
	(1 368)	370
Distribution		
Émises	4 565	5 597
Émises à partir du réinvestissement des distributions	3	1
Rachetées au cours de l'exercice	(2 443)	(2 518)
	2 125	3 080
Institutions en GBP (non couverte) :		
Distribution		
Émises	422	2 618
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(630)	(171)
	(208)	2 447

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Global Bond ESG Fund (suite)	
Institutions en NOK (couverte) : Capitalisation		
Émises	106 405	115 579
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(25 926)	(25 774)
	80 479	89 805
Institutions en NZD (couverte) : Distribution		
Émises	152	594
Émises à partir du réinvestissement des distributions	79	60
Rachetées au cours de l'exercice	(208)	0
	23	654
Institutions en SEK (couverte) : Capitalisation		
Émises	1 625	5 678
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 496)	0
	129	5 678
Investisseurs : Capitalisation		
Émises	569	429
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(813)	(974)
	(244)	(545)
Administrations : Capitalisation		
Émises	5	222
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(213)	(15)
	(208)	207
Distribution		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	0
	(1)	0
Catégorie E : Distribution		
Émises	251	64
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(39)	(433)
	212	(369)
Catégorie E en CHF (couverte) : Capitalisation		
Émises	8	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	8	S/O
Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation		
Émises	744	2 585
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 144)	(2 037)
	(400)	548
Catégorie Z en AUD (couverte) : Distribution		
Émises	18 505	14 150
Émises à partir du réinvestissement des distributions	557	254
Rachetées au cours de l'exercice	(4 344)	(343)
	14 718	14 061

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Global Bond Ex-US Fund	
Institutions : Capitalisation		
Émises	2 995	4 814
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(5 454)	(3 185)
	(2 459)	1 629
Distribution		
Émises	31	727
Émises à partir du réinvestissement des distributions	36	37
Rachetées au cours de l'exercice	(978)	(299)
	(911)	465
Institutions en EUR (couverte) : Capitalisation		
Émises	1 935	4 021
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(434)	(4 604)
	1 501	(583)
Institutions en GBP (couverte) : Distribution		
Émises	S/O	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	S/O	0
Rachetées au cours de l'exercice	S/O	(20)
	S/O	(20)
Investisseurs : Capitalisation		
Émises	11	127
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(427)	(276)
	(416)	(149)
Administrations : Capitalisation		
Émises	14	161
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(35)	(73)
	(21)	88
Catégorie E : Distribution		
Émises	6 630	3 203
Émises à partir du réinvestissement des distributions	8	11
Rachetées au cours de l'exercice	(8 332)	(2 671)
	(1 694)	543
Catégorie E (exposition au risque de change) : Distribution		
Émises	1 441	3 879
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 725)	(950)
	(284)	2 929
H Institutions : Capitalisation		
Émises	8 239	1 164
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(7 676)	(7 488)
	563	(6 324)
Catégorie Z : Capitalisation		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 092)	0
	(2 092)	0

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	49	201
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(94)	(746)
	(45)	(545)
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	3 042	12 653
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(7 884)	(2 648)
	(4 842)	10 005
Institutions en GBP (couverte) :		
Distribution		
Émises	10	7
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(24)	(11)
	(14)	(4)
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	135	2
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2)	(4)
	133	(2)
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	254	581
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(278)	(421)
	(24)	160
Distribution		
Émises	520	631
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	(245)	(209)
	276	423
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	5 168	2 786
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 215)	(2 570)
	1 953	216
Distribution		
Émises	1 520	2 176
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 000)	(967)
	520	1 209
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Distribution		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund (suite)	
Catégorie Z :		
Capitalisation		
Émises	0	2 314
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(711)	(279)
	(711)	2 035
	Fonds Global High Yield Bond Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	6 545	15 507
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(13 417)	(24 441)
	(6 872)	(8 934)
Distribution		
Émises	966	16 960
Émises à partir du réinvestissement des distributions	51	90
Rachetées au cours de l'exercice	(14 027)	(4 620)
	(13 010)	12 430
Institutions en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	31	60
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(681)	(236)
	(650)	(176)
Distribution		
Émises	133	305
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 560)	(461)
	(1 427)	(156)
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	7 994	30 775
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(24 025)	(28 676)
	(16 031)	2 099
Distribution		
Émises	9 520	6 449
Émises à partir du réinvestissement des distributions	159	59
Rachetées au cours de l'exercice	(4 069)	(5 518)
	5 610	990
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 473	11 704
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(13 780)	(3 274)
	(12 307)	8 430
Distribution		
Émises	22 851	35 263
Émises à partir du réinvestissement des distributions	46	88
Rachetées au cours de l'exercice	(59 227)	(49 041)
	(36 330)	(13 690)
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	0	338
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(753)	(376)
	(753)	(38)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Global High Yield Bond Fund (suite)	
Investisseurs en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	899	128
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(550)	(33)
	349	95
Administrations :		
Capitalisation		
Émises	105	309
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(710)	(230)
	(605)	79
Distribution		
Émises	49	1 052
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(780)	(740)
	(731)	312
Administrations en EUR (couverte) :		
Distribution		
Émises	0	31
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	(197)	(59)
	(196)	(27)
Administrations en GBP (couverte) :		
Distribution		
Émises	1	14
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(107)	(48)
	(106)	(34)
BM Détail :		
Distribution II		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	1 171	2 149
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 802)	(3 300)
	(1 631)	(1 151)
Distribution		
Émises	14 617	19 557
Émises à partir du réinvestissement des distributions	22	38
Rachetées au cours de l'exercice	(16 703)	(26 055)
	(2 064)	(6 460)
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	3 171	5 245
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4 821)	(4 985)
	(1 650)	260
Distribution		
Émises	290	628
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(810)	(1 096)
	(520)	(468)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Global High Yield Bond Fund (suite)	
Catégorie E en GBP (couverte) :		
Distribution		
Émises	6	198
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(29)	(186)
	(23)	12
Catégorie E en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	193	563
Émises à partir du réinvestissement des distributions	9	19
Rachetées au cours de l'exercice	(607)	(326)
	(405)	256
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	11 210	577
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(5 391)	(6 559)
	5 819	(5 982)
Distribution		
Émises	165	795
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(767)	(699)
	(602)	96
M Détail :		
Distribution		
Émises	326	465
Émises à partir du réinvestissement des distributions	2	12
Rachetées au cours de l'exercice	(769)	(907)
	(441)	(430)
Distribution II		
Émises	23 666	43 897
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	2
Rachetées au cours de l'exercice	(30 871)	(37 400)
	(7 205)	6 499
Catégorie R :		
Capitalisation		
Émises	834	1 898
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(5 248)	(2 079)
	(4 414)	(181)
Catégorie T :		
Capitalisation		
Émises	15	108
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(121)	(153)
	(106)	(45)
Distribution		
Émises	15	85
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(42)	(115)
	(27)	(30)
Catégorie T en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	29
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(130)	(31)
	(130)	(2)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Global Investment Grade Credit Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	44 338	68 033
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(76 437)	(139 841)
	(32 099)	(71 808)
Distribution		
Émises	7 013	26 790
Émises à partir du réinvestissement des distributions	125	153
Rachetées au cours de l'exercice	(16 764)	(59 200)
	(9 626)	(32 257)
Institutions (exposition au risque de change) :		
Capitalisation		
Émises	3 744	969
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 549)	(3 630)
	2 195	(2 661)
Distribution		
Émises	221	976
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(735)	(1 988)
	(514)	(1 012)
Institutions en AUD (couverte) :		
Distribution		
Émises	95	2 747
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(7 762)	(11 732)
	(7 667)	(8 985)
Institutions en CAD (couverte) :		
Distribution		
Émises	35	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	0
Rachetées au cours de l'exercice	(37)	0
	(1)	1
Institutions en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	6 544	5 532
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(7 451)	(16 291)
	(907)	(10 759)
Distribution		
Émises	521	724
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	2
Rachetées au cours de l'exercice	(1 364)	(2 072)
	(842)	(1 346)
Institutions en CZK (couverte) :		
Distribution		
Émises	0	1 275
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1 556	4 623
Rachetées au cours de l'exercice	(176 854)	(21 104)
	(175 298)	(15 206)
Institutions en EUR (exposition au risque de change) :		
Capitalisation		
Émises	1 445	2 368
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(741)	(1 014)
	704	1 354

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)	
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	28 528	59 639
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(58 533)	(137 154)
	(30 005)	(77 515)
Distribution		
Émises	7 044	22 042
Émises à partir du réinvestissement des distributions	13	200
Rachetées au cours de l'exercice	(27 790)	(13 754)
	(20 733)	8 488
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 218	2 579
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(6 780)	(10 548)
	(5 562)	(7 969)
Distribution		
Émises	12 235	42 221
Émises à partir du réinvestissement des distributions	31	24
Rachetées au cours de l'exercice	(66 400)	(193 097)
	(54 134)	(150 852)
Institutions en HUF (couverte) :		
Distribution		
Émises	509	1 973
Émises à partir du réinvestissement des distributions	3 701	28 468
Rachetées au cours de l'exercice	(1 029 911)	(38)
	(1 025 701)	30 403
Institutions en ILS (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	169
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(531)	(13 032)
	(531)	(12 863)
Institutions en NOK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	146	167
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(898)	(277)
	(752)	(110)
Institutions en PLN (couverte) :		
Distribution		
Émises	0	9 639
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(11 435)	(461)
	(11 435)	9 178
Institutions en SEK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 808	7 545
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(37 339)	(24 846)
	(35 531)	(17 301)
Institutions en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	938	284
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(396)	(4 362)
	542	(4 078)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)	
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	24 529	46 612
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(43 856)	(75 537)
	(19 327)	(28 925)
Distribution		
Émises	7 701	883
Émises à partir du réinvestissement des distributions	18	19
Rachetées au cours de l'exercice	(2 854)	(13 044)
	4 865	(12 142)
Investisseurs en AUD (couverte) :		
Distribution		
Émises	824	206
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(133)	(443)
	691	(237)
Investisseurs en CAD (couverte) :		
Distribution		
Émises	0	325
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	1
Rachetées au cours de l'exercice	(175)	(451)
	(175)	(125)
Investisseurs en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	11	47
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(94)	(81)
	(83)	(34)
Distribution		
Émises	16	37
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(145)	(164)
	(129)	(127)
Investisseurs en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	672	527
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 603)	(1 593)
	(931)	(1 066)
Distribution		
Émises	18	234
Émises à partir du réinvestissement des distributions	2	2
Rachetées au cours de l'exercice	(218)	(193)
	(198)	43
Investisseurs en GBP (couverte) :		
Distribution		
Émises	17	61
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(61)	(240)
	(44)	(179)
Investisseurs en RMB (couverte) :		
Distribution		
Émises	0	10
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(30)	(47)
	(30)	(37)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)	
Investisseurs en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	288	282
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(151)	(1 456)
	137	(1 174)
Administrations :		
Capitalisation		
Émises	272	808
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(6 285)	(1 832)
	(6 013)	(1 024)
Distribution		
Émises	651	502
Émises à partir du réinvestissement des distributions	9	4
Rachetées au cours de l'exercice	(3 753)	(13 807)
	(3 093)	(13 301)
Administrations en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(13)	(78)
	(13)	(78)
Administrations en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	215	18
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(235)	(660)
	(20)	(642)
Distribution		
Émises	220	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(180)	(314)
	40	(313)
Administrations en GBP (couverte) :		
Distribution		
Émises	71	33
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	(176)	(199)
	(104)	(165)
Administrations en HKD (non couverte) :		
Distribution		
Émises	4 427	2 219
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4 427)	(4 812)
	0	(2 593)
Administrations en SEK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	72 625	29 416
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(59 977)	(49 738)
	12 648	(20 322)
Administrations en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	9	199
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	2
Rachetées au cours de l'exercice	(197)	(4 256)
	(188)	(4 055)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)	
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	9 251	8 525
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(13 142)	(33 255)
	(3 891)	(24 730)
Distribution		
Émises	5 108	9 923
Émises à partir du réinvestissement des distributions	73	90
Rachetées au cours de l'exercice	(10 629)	(27 562)
	(5 448)	(17 549)
Catégorie E en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	265	1 147
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 399)	(1 678)
	(1 134)	(531)
Catégorie E en EUR (exposition au risque de change) :		
Distribution		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(140)	(153)
	(140)	(153)
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	12 147	14 083
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(16 618)	(20 477)
	(4 471)	(6 394)
Distribution		
Émises	946	1 198
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	(3 458)	(7 639)
	(2 511)	(6 440)
Catégorie E en GBP (couverte) :		
Distribution		
Émises	134	321
Émises à partir du réinvestissement des distributions	3	3
Rachetées au cours de l'exercice	(535)	(1 135)
	(398)	(811)
Catégorie E en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	862	377
Émises à partir du réinvestissement des distributions	4	5
Rachetées au cours de l'exercice	(875)	(4 484)
	(9)	(4 102)
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	21 140	3 728
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(13 895)	(11 759)
	7 245	(8 031)
Distribution		
Émises	1 741	481
Émises à partir du réinvestissement des distributions	33	21
Rachetées au cours de l'exercice	(1 125)	(264)
	649	238

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)	
H Institutions (exposition au risque de change) :		
Capitalisation		
Émises	22 933	1 279
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(84)	(1 278)
	22 849	1
M Détail :		
Distribution		
Émises	326	609
Émises à partir du réinvestissement des distributions	2	3
Rachetées au cours de l'exercice	(2 065)	(6 740)
	(1 737)	(6 128)
Distribution II		
Émises	5 726	12 952
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	4
Rachetées au cours de l'exercice	(7 045)	(18 906)
	(1 318)	(5 950)
M Détail en HKD (non couverte) :		
Distribution		
Émises	103	1 063
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	(5 440)
	103	(4 377)
Catégorie R :		
Capitalisation		
Émises	143	492
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(790)	(1 143)
	(647)	(651)
Distribution		
Émises	30	293
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(122)	(389)
	(92)	(96)
Catégorie R en EUR (couverte) :		
Distribution		
Émises	3	31
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(275)	(363)
	(272)	(332)
Catégorie R en GBP (couverte) :		
Distribution		
Émises	285	277
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(428)	(1 621)
	(143)	(1 344)
Catégorie T :		
Capitalisation		
Émises	333	712
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(985)	(2 144)
	(652)	(1 432)
Catégorie T en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	58	53
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(111)	(276)
	(53)	(223)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)	
Catégorie W :		
Capitalisation		
Émises	802	4 889
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 534)	(5 189)
	(2 732)	(300)
Distribution		
Émises	600	2 963
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 279)	(3 843)
	(679)	(880)
Catégorie W en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	55	482
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(893)	(796)
	(838)	(314)
Catégorie W en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	3 284	29 818
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(16 428)	(16 260)
	(13 144)	13 558
Distribution		
Émises	32	118
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(116)	(153)
	(84)	(35)
Catégorie W en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	378	56
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(44)	(6)
	334	50
Distribution		
Émises	94	1 111
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(881)	(964)
	(787)	147
Catégorie W en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	561	141
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(81)	(59)
	480	82

	Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	3 548	1 206
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(835)	(1 421)
	2 713	(215)
Distribution		
Émises	582	1 084
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 240)	(1 965)
	(658)	(881)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)	
Institutions en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	5 476	15 362
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 599)	(3 688)
	3 877	11 674
Distribution		
Émises	3	296
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(54)	(11)
	(51)	285
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	15 414	23 011
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(12 338)	(7 272)
	3 076	15 739
Distribution		
Émises	46 158	7 007
Émises à partir du réinvestissement des distributions	40	49
Rachetées au cours de l'exercice	(10 802)	(4 993)
	35 396	2 063
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	2 854	5 957
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 656)	(136)
	198	5 821
Distribution		
Émises	452	13 892
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(5 089)	(215)
	(4 637)	13 677
Institutions en SEK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	106	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	106	S/O
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	11	14
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	11	14
Administrations en SEK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	30 800	22 329
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(17 723)	(3 650)
	13 077	18 679
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	44	147
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(216)	(786)
	(172)	(639)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)		
Distribution		
Émises	0	52
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(29)	(309)
	(29)	(257)
Catégorie E en CHF (couverte) : Capitalisation		
Émises	47	23
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(6)	(193)
	41	(170)
Distribution		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	0	0
Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation		
Émises	60	535
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(363)	(468)
	(303)	67
Distribution		
Émises	13	45
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(29)	(12)
	(16)	33
Catégorie E en GBP (couverte) : Capitalisation		
Émises	0	5
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	(6)
	0	(1)
Distribution		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(10)	(1)
	(10)	(1)
Catégorie Z : Capitalisation		
Émises	0	1 406
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	0	1 406
Fonds Global Low Duration Real Return Fund		
Institutions : Capitalisation		
Émises	17 233	10 517
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(18 259)	(8 567)
	(1 026)	1 950
Institutions en CHF (couverte) : Capitalisation		
Émises	282	2 645
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 169)	(552)
	(887)	2 093

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Global Low Duration Real Return Fund (suite)		
Institutions en EUR (couverte) : Capitalisation		
Émises	37 827	24 857
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(38 154)	(11 137)
	(327)	13 720
Distribution		
Émises	67	1 155
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(841)	(527)
	(774)	628
Institutions en GBP (couverte) : Capitalisation		
Émises	3 306	3 977
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 949)	(1 231)
	(643)	2 746
Distribution		
Émises	3 506	3 496
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 465)	(861)
	1 041	2 635
Institutions en SGD (couverte) : Capitalisation		
Émises	34 943	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	34 943	S/O
Investisseurs : Capitalisation		
Émises	344	122
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(196)	(18)
	148	104
Catégorie E : Capitalisation		
Émises	2 786	1 483
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 966)	(569)
	820	914
Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation		
Émises	10 191	12 372
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(7 015)	(1 750)
	3 176	10 622
Fonds Global Real Return Fund		
Institutions : Capitalisation		
Émises	4 831	11 978
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(6 987)	(6 198)
	(2 156)	5 780
Distribution		
Émises	129	257
Émises à partir du réinvestissement des distributions	5	1
Rachetées au cours de l'exercice	(474)	(471)
	(340)	(213)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Global Real Return Fund (suite)		
Institutions (exposition au risque de change) :		
Capitalisation		
Émises	0	673
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(715)	(2 134)
	(715)	(1 461)
Institutions en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	761	933
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(401)	(392)
	360	541
Distribution		
Émises	634	382
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(174)	(172)
	460	210
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	19 760	28 176
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(22 869)	(17 050)
	(3 109)	11 126
Distribution		
Émises	400	1 324
Émises à partir du réinvestissement des distributions	187	90
Rachetées au cours de l'exercice	(1 252)	(2 194)
	(665)	(780)
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 338	2 279
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 217)	(1 586)
	121	693
Distribution		
Émises	5 537	25 986
Émises à partir du réinvestissement des distributions	49	36
Rachetées au cours de l'exercice	(6 352)	(7 853)
	(766)	18 169
Institutions en SGD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	152	8 765
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 418)	(1 247)
	(1 266)	7 518
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	900	1 561
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 580)	(773)
	(680)	788
Distribution		
Émises	2	910
Émises à partir du réinvestissement des distributions	43	30
Rachetées au cours de l'exercice	(1 171)	(414)
	(1 126)	526

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Global Real Return Fund (suite)		
Investisseurs en CHF (couverte) :		
Distribution		
Émises	7	137
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(135)	(75)
	(128)	62
Investisseurs en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	84	1 141
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(489)	(152)
	(405)	989
Administrations :		
Capitalisation		
Émises	382	730
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 192)	(414)
	(810)	316
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	3 430	7 307
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(5 529)	(4 268)
	(2 099)	3 039
Distribution		
Émises	1 089	1 985
Émises à partir du réinvestissement des distributions	57	18
Rachetées au cours de l'exercice	(1 375)	(714)
	(229)	1 289
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	3 812	8 455
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(5 495)	(3 422)
	(1 683)	5 033
Catégorie E en GBP (couverte) :		
Distribution		
Émises	53	134
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	(336)	(24)
	(282)	111
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	2 482	4 492
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4 207)	(552)
	(1 725)	3 940
Catégorie R :		
Capitalisation		
Émises	13	413
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(395)	(41)
	(382)	372
Catégorie R en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	178	286
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(375)	(411)
	(197)	(125)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Income Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	205 515	280 834
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(266 612)	(241 043)
	(61 097)	39 791
Distribution		
Émises	134 393	206 975
Émises à partir du réinvestissement des distributions	2 459	993
Rachetées au cours de l'exercice	(143 512)	(128 915)
	(6 660)	79 053
Institutions en AUD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	200	1 063
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(918)	(570)
	(718)	493
Distribution		
Émises	123	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(124)	0
	(1)	1
Institutions en BRL (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 312	6 235
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(24 928)	(8 888)
	(23 616)	(2 653)
Institutions en CAD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	352	232
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(937)	(1 455)
	(585)	(1 223)
Distribution		
Émises	95	1 469
Émises à partir du réinvestissement des distributions	7	6
Rachetées au cours de l'exercice	(492)	(226)
	(390)	1 249
Institutions en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	4 888	7 308
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4 933)	(3 326)
	(45)	3 982
Distribution		
Émises	2 143	5 466
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4 171)	(5 504)
	(2 028)	(38)
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	305 996	445 245
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(373 923)	(474 365)
	(67 927)	(29 120)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Income Fund (suite)	
Distribution		
Émises	28 529	57 671
Émises à partir du réinvestissement des distributions	264	143
Rachetées au cours de l'exercice	(49 457)	(31 092)
	(20 664)	26 722
Distribution II		
Émises	768	1 354
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	9
Rachetées au cours de l'exercice	(1 351)	(4 975)
	(583)	(3 612)
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	2 926	19 942
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(5 345)	(1 397)
	(2 419)	18 545
Distribution		
Émises	8 905	8 923
Émises à partir du réinvestissement des distributions	38	72
Rachetées au cours de l'exercice	(5 318)	(4 599)
	3 625	4 396
Institutions en HKD (non couverte) :		
Distribution		
Émises	7 384	7 104
Émises à partir du réinvestissement des distributions	17	14
Rachetées au cours de l'exercice	(33 765)	(6 571)
	(26 364)	547
Institutions en JPY (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	123	69
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(352)	(21)
	(229)	48
Institutions en NOK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	4 029	2 065
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 602)	(2 257)
	1 427	(192)
Institutions en RMB (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	0
	(1)	1
Institutions en SGD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	3 501	5 593
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 109)	(1 589)
	1 392	4 004
Distribution		
Émises	7 373	9 167
Émises à partir du réinvestissement des distributions	65	133
Rachetées au cours de l'exercice	(8 523)	(8 499)
	(1 085)	801

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Income Fund (suite)	
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	21 157	95 403
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(74 160)	(40 915)
	(53 003)	54 488
Distribution		
Émises	36 086	68 127
Émises à partir du réinvestissement des distributions	161	135
Rachetées au cours de l'exercice	(44 046)	(29 096)
	(7 799)	39 166
Investisseurs en AUD (couverte) :		
Distribution		
Émises	1 063	3 049
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	1
Rachetées au cours de l'exercice	(1 007)	(814)
	56	2 236
Investisseurs en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	57 324	67 182
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(79 974)	(147 319)
	(22 650)	(80 137)
Distribution		
Émises	1 522	6 631
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 390)	(1 493)
	(1 868)	5 138
Distribution A		
Émises	161	348
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(540)	(452)
	(379)	(104)
Investisseurs en GBP (couverte) :		
Distribution		
Émises	1 302	596
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(272)	(51)
	1 030	545
Investisseurs en RMB (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	734
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(415)	(1 857)
	(415)	(1 123)
Investisseurs en SGD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	508	371
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(68)	(198)
	440	173
Distribution		
Émises	2 208	3 753
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 473)	(778)
	(1 265)	2 975

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Income Fund (suite)	
Administrations :		
Capitalisation		
Émises	8 620	36 185
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(16 949)	(14 538)
	(8 329)	21 647
Distribution		
Émises	66 046	98 909
Émises à partir du réinvestissement des distributions	410	332
Rachetées au cours de l'exercice	(96 953)	(69 234)
	(30 497)	30 007
Administrations en AUD (couverte) :		
Distribution		
Émises	5 920	3 417
Émises à partir du réinvestissement des distributions	74	56
Rachetées au cours de l'exercice	(4 398)	(6 578)
	1 596	(3 105)
Administrations en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	16 413	4 326
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(23 680)	(8 652)
	(7 267)	(4 326)
Distribution		
Émises	9 626	10 025
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(9 123)	(11 507)
	503	(1 482)
Administrations en GBP (couverte) :		
Distribution		
Émises	2 145	2 686
Émises à partir du réinvestissement des distributions	58	38
Rachetées au cours de l'exercice	(3 252)	(2 284)
	(1 049)	440
Administrations en HKD (non couverte) :		
Distribution		
Émises	102 825	242 800
Émises à partir du réinvestissement des distributions	36	51
Rachetées au cours de l'exercice	(201 758)	(96 356)
	(98 897)	146 495
Administrations en JPY (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	713	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(714)	0
	(1)	1
Administrations en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	19 561	20 372
Émises à partir du réinvestissement des distributions	312	221
Rachetées au cours de l'exercice	(16 816)	(15 212)
	3 057	5 381
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	72 634	109 426
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(124 100)	(95 494)
	(51 466)	13 932

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Income Fund (suite)	
Distribution		
Émises	129 484	283 751
Émises à partir du réinvestissement des distributions	2 095	1 594
Rachetées au cours de l'exercice	(212 567)	(195 273)
	(80 988)	90 072
Distribution Q		
Émises	142	106
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(345)	(83)
	(203)	23
Catégorie E en AUD (couverte) : Distribution		
Émises	9 508	18 516
Émises à partir du réinvestissement des distributions	317	234
Rachetées au cours de l'exercice	(10 371)	(15 777)
	(546)	2 973
Catégorie E en CHF (couverte) : Capitalisation		
Émises	659	1 489
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 563)	(1 340)
	(904)	149
Distribution		
Émises	2 434	1 801
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4 987)	(4 019)
	(2 553)	(2 218)
Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation		
Émises	69 869	119 154
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(84 120)	(101 651)
	(14 251)	17 503
Distribution		
Émises	58 606	72 128
Émises à partir du réinvestissement des distributions	67	53
Rachetées au cours de l'exercice	(90 970)	(110 213)
	(32 297)	(38 032)
Distribution II		
Émises	3 524	3 933
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 127)	(4 101)
	1 397	(168)
Distribution II Q		
Émises	911	3 124
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 774)	(1 352)
	(863)	1 772
Catégorie E en GBP (couverte) : Distribution		
Émises	5 514	8 527
Émises à partir du réinvestissement des distributions	46	38
Rachetées au cours de l'exercice	(4 932)	(9 644)
	628	(1 079)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Income Fund (suite)	
Catégorie E en HKD (non couverte) : Distribution		
Émises	68 787	77 394
Émises à partir du réinvestissement des distributions	267	157
Rachetées au cours de l'exercice	(142 484)	(152 376)
	(73 430)	(74 825)
Catégorie E en JPY (couverte) : Capitalisation		
Émises	3 694	562
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(138)	(2 365)
	3 556	(1 803)
Distribution		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Catégorie E en RMB (couverte) : Distribution		
Émises	842	3 921
Émises à partir du réinvestissement des distributions	26	16
Rachetées au cours de l'exercice	(1 768)	(3 355)
	(900)	582
Catégorie E en SGD (couverte) : Distribution		
Émises	71 590	79 819
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1 221	862
Rachetées au cours de l'exercice	(58 744)	(66 148)
	14 067	14 533
G Détail en EUR (couverte) : Distribution		
Émises	291	380
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 161)	(918)
	(870)	(538)
G Détail en EUR (non couverte) : Distribution		
Émises	5	40
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(56)	(18)
	(51)	22
H Institutions : Capitalisation		
Émises	21 920	40 755
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(25 642)	(24 565)
	(3 722)	16 190
Distribution		
Émises	8 454	17 691
Émises à partir du réinvestissement des distributions	625	450
Rachetées au cours de l'exercice	(9 681)	(14 432)
	(602)	3 709
H Institutions en EUR (couverte) : Capitalisation		
Émises	144	773
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(916)	(246)
	(772)	527

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Income Fund (suite)		
Catégorie R :		
Capitalisation		
Émises	2 924	4 028
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 290)	(500)
	1 634	3 528
Distribution		
Émises	491	2 279
Émises à partir du réinvestissement des distributions	33	19
Rachetées au cours de l'exercice	(1 911)	(861)
	(1 387)	1 437
Catégorie R en EUR (couverte) :		
Distribution		
Émises	215	630
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	4
Rachetées au cours de l'exercice	(327)	(470)
	(111)	164
Catégorie R en GBP (couverte) :		
Distribution		
Émises	925	1 256
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	2
Rachetées au cours de l'exercice	(1 828)	(1 013)
	(903)	245
Catégorie T :		
Capitalisation		
Émises	3 483	6 467
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(7 146)	(5 882)
	(3 663)	585
Distribution		
Émises	745	2 853
Émises à partir du réinvestissement des distributions	119	90
Rachetées au cours de l'exercice	(2 127)	(2 645)
	(1 263)	298
Catégorie T en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	2 767	3 695
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4 018)	(4 848)
	(1 251)	(1 153)
Distribution		
Émises	2 094	3 656
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4 633)	(6 603)
	(2 539)	(2 947)
Catégorie Z :		
Capitalisation		
Émises	4 085	2 955
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	(255)
	4 085	2 700
Catégorie Z en AUD (couverte) :		
Distribution II		
Émises	17 238	35 574
Émises à partir du réinvestissement des distributions	6 580	3 965
Rachetées au cours de l'exercice	(16 520)	(8 855)
	7 298	30 684

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Income Fund II		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	0	2 396
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	0	2 396
Distribution		
Émises	0	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	0
	(1)	1
Catégorie E :		
Distribution		
Émises	2 007	173
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	(113)	0
	1 895	174
Catégorie E en AUD (couverte) :		
Distribution		
Émises	210	36
Émises à partir du réinvestissement des distributions	2	1
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	212	37
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Distribution		
Émises	362	50
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	0
Rachetées au cours de l'exercice	(28)	0
	335	50
Catégorie E en GBP (couverte) :		
Distribution		
Émises	332	20
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	0
Rachetées au cours de l'exercice	(24)	0
	309	20
Catégorie E en HKD (non couverte) :		
Distribution		
Émises	8 423	246
Émises à partir du réinvestissement des distributions	11	1
Rachetées au cours de l'exercice	(1 455)	0
	6 979	247
Catégorie E en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	3	33
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	(38)	0
	(34)	34
Fonds Inflation Multi-Asset Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	3 039	2 300
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 334)	(1 765)
	1 705	535

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Inflation Multi-Asset Fund (suite)		
Institutions en EUR (partiellement couverte) :		
Capitalisation		
Émises	11 234	477
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 993)	0
	8 241	477
Institutions en GBP (partiellement couverte) :		
Capitalisation		
Émises	2 046	1 785
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 662)	(68)
	(1 616)	1 717
Administrations :		
Distribution II		
Émises	334	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	5	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	(1)	S/O
	338	S/O
Administrations en SGD (couverte) :		
Distribution II		
Émises	3 086	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	28	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	(1 917)	S/O
	1 197	S/O
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	10 246	1 305
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 978)	(173)
	7 268	1 132
Distribution II		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Catégorie E en AUD (partiellement couverte) :		
Capitalisation		
Émises	36	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	36	S/O
Catégorie E en EUR (partiellement couverte) :		
Capitalisation		
Émises	12 001	3 203
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 471)	(450)
	8 530	2 753
Distribution		
Émises	1 435	535
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(731)	(64)
	704	471
Catégorie E en GBP (partiellement couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Inflation Multi-Asset Fund (suite)		
Catégorie E en SGD (partiellement couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
M Détail :		
Distribution II		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Fonds Low Average Duration Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	17 557	21 991
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(22 086)	(25 184)
	(4 529)	(3 193)
Distribution		
Émises	3 385	343
Émises à partir du réinvestissement des distributions	24	3
Rachetées au cours de l'exercice	(1 191)	(687)
	2 218	(341)
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	3 251	779
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 789)	(724)
	462	55
Distribution		
Émises	416	875
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	0
Rachetées au cours de l'exercice	(449)	(714)
	(32)	161
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	534	1 360
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(133)	(634)
	401	726
Distribution		
Émises	11	96
Émises à partir du réinvestissement des distributions	2	1
Rachetées au cours de l'exercice	(85)	(799)
	(72)	(702)
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	1	4
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(229)	(590)
	(228)	(586)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Low Average Duration Fund (suite)		
Distribution		
Émises	33	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	0
Rachetées au cours de l'exercice	(590)	(140)
	(556)	(140)
Administrations :		
Capitalisation		
Émises	203	29
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(181)	(310)
	22	(281)
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	9 196	2 629
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(9 321)	(4 822)
	(125)	(2 193)
Distribution		
Émises	60	210
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	0
Rachetées au cours de l'exercice	(154)	(840)
	(93)	(630)
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 475	737
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(446)	(775)
	1 029	(38)
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	77 194	18 172
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(76 411)	(8 901)
	783	9 271
Distribution		
Émises	97	860
Émises à partir du réinvestissement des distributions	3	4
Rachetées au cours de l'exercice	(686)	(796)
	(586)	68
Catégorie R :		
Capitalisation		
Émises	250	412
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(228)	(269)
	22	143
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	8 468	5 684
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(5 711)	(5 451)
	2 757	233
Distribution		
Émises	1 830	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	28	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	1 858	1

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (suite)		
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	3 012	19 459
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(9 445)	(3 904)
	(6 433)	15 555
Distribution		
Émises	2	95
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(82)	0
	(80)	95
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	263	1 089
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(166)	(1 232)
	97	(143)
Distribution		
Émises	153	1 878
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 570)	(29)
	(1 417)	1 849
Institutions en NOK (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 345	298
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 883)	(43)
	(2 538)	255
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 820	969
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(771)	(1 213)
	1 049	(244)
Fonds Low Duration Income Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	17 232	24 771
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(24 502)	(997)
	(7 270)	23 774
Distribution		
Émises	401	1 281
Émises à partir du réinvestissement des distributions	2	2
Rachetées au cours de l'exercice	(479)	(174)
	(76)	1 109
Institutions en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	16	206
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(194)	(67)
	(178)	139
Distribution		
Émises	S/O	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	S/O	0
Rachetées au cours de l'exercice	S/O	(1)
	S/O	(1)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Low Duration Income Fund (suite)		
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	7 973	7 782
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(7 357)	(2 713)
	616	5 069
Distribution		
Émises	5	6 036
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(6 040)	0
	(6 035)	6 036
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	10	298
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(169)	(13 944)
	(159)	(13 646)
Distribution		
Émises	51	15 454
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(7 884)	(2 083)
	(7 833)	13 371
Institutions en SGD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	836	2 832
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 153)	(1 006)
	(317)	1 826
Investisseurs en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	60
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(61)	0
	(61)	60
Distribution		
Émises	0	47
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(48)	0
	(48)	47
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	9 022	1 555
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(7 895)	(181)
	1 127	1 374
Distribution		
Émises	496	963
Émises à partir du réinvestissement des distributions	4	0
Rachetées au cours de l'exercice	(519)	(161)
	(19)	802
Catégorie E en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	S/O	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	S/O	0
Rachetées au cours de l'exercice	S/O	(1)
	S/O	(1)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Low Duration Income Fund (suite)		
Distribution		
Émises	S/O	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	S/O	0
Rachetées au cours de l'exercice	S/O	(1)
	S/O	(1)
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	5 036	1 556
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 364)	(62)
	1 672	1 494
Distribution		
Émises	291	124
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(78)	(43)
	213	81
Catégorie E en SGD (couverte) :		
Distribution		
Émises	4	18
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	(78)	(17)
	(73)	2
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	14 535	348
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(8 743)	(5)
	5 792	343
Distribution		
Émises	164	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	(119)	S/O
	45	S/O
Catégorie Z en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	0	0
Fonds Low Duration Opportunities Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	15 819	10 426
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(22 277)	(6 509)
	(6 458)	3 917
Distribution		
Émises	9	3 927
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(505)	(706)
	(496)	3 221
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 940	2 661
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 402)	(3 829)
	(1 462)	(1 168)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Low Duration Opportunities Fund (suite)	
Distribution		
Émises	1 502	343
Émises à partir du réinvestissement des distributions	10	5
Rachetées au cours de l'exercice	(1 565)	(1 847)
	(53)	(1 499)
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	39 578	63 558
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(125 565)	(34 712)
	(85 987)	28 846
Distribution		
Émises	7 687	26 846
Émises à partir du réinvestissement des distributions	71	43
Rachetées au cours de l'exercice	(20 525)	(16 871)
	(12 767)	10 018
Investisseurs en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	15	382
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(336)	(612)
	(321)	(230)
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	67	101
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(160)	(224)
	(93)	(123)
Catégorie Z :		
Capitalisation		
Émises	0	301
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(135)	0
	(135)	301

	Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	446	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	446	S/O
Distribution		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	23	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	23	S/O
Distribution		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund (suite)	
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	20	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	20	S/O
Distribution		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O

	Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	1 904	2 566
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 448)	(3 977)
	(544)	(1 411)
Distribution		
Émises	81	48
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4 100)	(2 236)
	(4 019)	(2 188)
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	3 125	1 766
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(995)	(675)
	2 130	1 091
Distribution		
Émises	351	30
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(181)	(36)
	170	(6)
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	5
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(31)	(7)
	(31)	(2)
Distribution		
Émises	0	5
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(5)	(30)
	(5)	(25)
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	0	4
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(117)	(55)
	(117)	(51)
Distribution		
Émises	S/O	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	S/O	0
Rachetées au cours de l'exercice	S/O	(1)
	S/O	(1)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (suite)		
Investisseurs en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	S/O	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	S/O	0
Rachetées au cours de l'exercice	S/O	(4)
	S/O	(4)
Catégorie E :		
Distribution		
Émises	5 241	1 631
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 306)	(712)
	1 936	919
Catégorie Z :		
Capitalisation		
Émises	0	296
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	(1)
	0	295
Fonds Mortgage Opportunities Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	25 921	23 801
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(35 398)	(18 996)
	(9 477)	4 805
Distribution		
Émises	1 777	16 326
Émises à partir du réinvestissement des distributions	447	428
Rachetées au cours de l'exercice	(26 696)	(9 909)
	(24 472)	6 845
Institutions en CAD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	2 532
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	0	2 532
Institutions en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	53	42
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(263)	(180)
	(210)	(138)
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	12 444	36 296
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(22 004)	(37 924)
	(9 560)	(1 628)
Distribution		
Émises	134	2 122
Émises à partir du réinvestissement des distributions	43	4
Rachetées au cours de l'exercice	(1 207)	(214)
	(1 030)	1 912

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite)		
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	35 235	4 017
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(36 241)	(3 014)
	(1 006)	1 003
Distribution		
Émises	615	716
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(484)	(1 299)
	131	(583)
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	155	829
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 077)	(2 443)
	(922)	(1 614)
Distribution		
Émises	29	809
Émises à partir du réinvestissement des distributions	3	5
Rachetées au cours de l'exercice	(1 403)	(100)
	(1 371)	714
Administrations :		
Distribution		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(49)	0
	(49)	0
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	1 235	1 440
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 163)	(2 086)
	(928)	(646)
Distribution		
Émises	51	374
Émises à partir du réinvestissement des distributions	3	2
Rachetées au cours de l'exercice	(575)	(429)
	(521)	(53)
Catégorie E en CHF (couverte) :		
Distribution		
Émises	0	3
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(14)	(5)
	(14)	(2)
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	270	456
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(446)	(653)
	(176)	(197)
Distribution		
Émises	0	3
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(17)	0
	(17)	3

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite)		
Catégorie E en SGD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	S/O	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	S/O	0
Rachetées au cours de l'exercice	S/O	(1)
	S/O	(1)
Distribution		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	(169)	(50)
	(168)	(49)
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	0	6
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3)	0
	(3)	6
Catégorie Z :		
Capitalisation		
Émises	1	12 616
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(19 628)	0
	(19 627)	12 616
Catégorie Z en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(34 658)	0
	(34 658)	0
Fonds StocksPLUS™ Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	7 763	30 395
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(34 505)	(45 187)
	(26 742)	(14 792)
Distribution		
Émises	1	59
Émises à partir du réinvestissement des distributions	6	0
Rachetées au cours de l'exercice	(186)	(465)
	(179)	(406)
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	5 360	3 917
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(16 644)	(6 823)
	(11 284)	(2 906)
Distribution		
Émises	0	5
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(68)	(5)
	(68)	0
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	461	18
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(23)	0
	438	18

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds StocksPLUS™ Fund (suite)		
Institutions en SGD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	41	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	(3)	S/O
	38	S/O
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	260	62
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(191)	(101)
	69	(39)
BE Détail :		
Capitalisation		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	1 702	2 404
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(970)	(1 259)
	732	1 145
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	4 253	293
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 398)	(184)
	1 855	109
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	16 223	26 279
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(46 974)	(8 745)
	(30 751)	17 534
Catégorie T :		
Capitalisation		
Émises	0	34
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(124)	(50)
	(124)	(16)
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	89	56
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(29)	(23)
	60	33
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	2	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(26)	0
	(24)	1

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund (suite)	
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1	18
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	1	18
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	0	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2)	0
	(2)	1
	Fonds Strategic Income Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	74	436
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(889)	(800)
	(815)	(364)
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	5 539	6 826
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(7 311)	(26 572)
	(1 772)	(19 746)
Institutions en GBP (couverte) :		
Distribution		
Émises	21	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	21	S/O
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	1 152	735
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(875)	(667)
	277	68
Distribution II		
Émises	760	363
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	(600)	(384)
	161	(20)
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	4 473	2 264
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 943)	(3 158)
	530	(894)
Distribution II		
Émises	1 437	1 767
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 014)	(2 755)
	(577)	(988)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds Strategic Income Fund (suite)	
Catégorie T en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	210	341
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(264)	(381)
	(54)	(40)
Distribution		
Émises	217	145
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(126)	(128)
	91	17
	Fonds Total Return Bond Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	14 515	20 002
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(12 236)	(29 064)
	2 279	(9 062)
Distribution		
Émises	1 043	1 445
Émises à partir du réinvestissement des distributions	144	110
Rachetées au cours de l'exercice	(3 382)	(1 942)
	(2 195)	(387)
Institutions en CAD (couverte) :		
Distribution		
Émises	0	656
Émises à partir du réinvestissement des distributions	7	5
Rachetées au cours de l'exercice	(960)	(618)
	(953)	43
Institutions en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	110	44
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(901)	(321)
	(791)	(277)
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	11 822	11 374
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(7 110)	(16 801)
	4 712	(5 427)
Distribution		
Émises	214	5 001
Émises à partir du réinvestissement des distributions	398	275
Rachetées au cours de l'exercice	(423)	(1 667)
	189	3 609
Institutions en EUR (non couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 047	1 364
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(799)	(2 078)
	248	(714)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Total Return Bond Fund (suite)		
Institutions en GBP (couverte) : Capitalisation		
Émises	89	7
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(172)	(286)
	(83)	(279)
Distribution		
Émises	1 008	1 070
Émises à partir du réinvestissement des distributions	20	14
Rachetées au cours de l'exercice	(1 840)	(512)
	(812)	572
Institutions en ILS (couverte) : Capitalisation		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(13)	(26)
	(13)	(26)
Institutions en SGD (couverte) : Capitalisation		
Émises	425	389
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 297)	(185)
	(872)	204
Investisseurs : Capitalisation		
Émises	6 860	2 569
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 170)	(8 776)
	3 690	(6 207)
Distribution		
Émises	4 075	178
Émises à partir du réinvestissement des distributions	6	8
Rachetées au cours de l'exercice	(1 523)	(5 176)
	2 558	(4 990)
Investisseurs en CHF (couverte) : Capitalisation		
Émises	28	20
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(138)	(135)
	(110)	(115)
Investisseurs en EUR (couverte) : Capitalisation		
Émises	441	14
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(277)	(341)
	164	(327)
Administrations : Capitalisation		
Émises	1 321	262
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 487)	(1 094)
	(166)	(832)
Distribution		
Émises	2 212	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	(1 730)	S/O
	482	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Total Return Bond Fund (suite)		
Administrations en EUR (couverte) : Capitalisation		
Émises	154	1
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(29)	(130)
	125	(129)
Catégorie E : Capitalisation		
Émises	2 883	1 915
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 718)	(8 128)
	(835)	(6 213)
Distribution		
Émises	1 010	1 408
Émises à partir du réinvestissement des distributions	33	55
Rachetées au cours de l'exercice	(2 318)	(4 098)
	(1 275)	(2 635)
Catégorie E en CHF (couverte) : Capitalisation		
Émises	744	36
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(131)	(108)
	613	(72)
Catégorie E en EUR (couverte) : Capitalisation		
Émises	2 661	1 779
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(5 090)	(10 901)
	(2 429)	(9 122)
Distribution		
Émises	431	540
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(909)	(2 278)
	(478)	(1 738)
Catégorie E en EUR (non couverte) : Capitalisation		
Émises	19	83
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(35)	(16)
	(16)	67
Catégorie E en HKD (non couverte) : Capitalisation		
Émises	82	211
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(186)	(178)
	(104)	33
Catégorie E en SGD (couverte) : Capitalisation		
Émises	97	268
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(163)	(342)
	(66)	(74)
H Institutions : Capitalisation		
Émises	8 179	1 136
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(10 096)	(1 227)
	(1 917)	(91)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds Total Return Bond Fund (suite)		
Distribution		
Émises	182	1 048
Émises à partir du réinvestissement des distributions	9	15
Rachetées au cours de l'exercice	(822)	(855)
	(631)	208
M Détail en HKD (non couverte) :		
Distribution		
Émises	99	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(29)	(286)
	70	(286)
Catégorie R en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	128	160
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(355)	(108)
	(227)	52
Catégorie T :		
Capitalisation		
Émises	96	549
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(616)	(902)
	(520)	(353)
Catégorie T en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	200	130
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(119)	(253)
	81	(123)
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	12 457	5 565
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4 248)	(1 555)
	8 209	4 010
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	10 855	47
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 198)	(175)
	9 657	(128)
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Distribution		
Émises	3 333	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	3 333	S/O
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (suite)		
Investisseurs en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	1	S/O
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	3 403	110
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 731)	(427)
	672	(317)
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 900	99
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(402)	(35)
	1 498	64
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	4	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	4	S/O
Catégorie Z :		
Capitalisation		
Émises	3 659	1 299
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	3 659	1 299
Fonds UK Corporate Bond Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	653	2 794
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 469)	(5 446)
	(816)	(2 652)
Distribution		
Émises	8 201	12 966
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	1
Rachetées au cours de l'exercice	(16 638)	(20 576)
	(8 437)	(7 609)
H Institutions :		
Distribution		
Émises	S/O	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	S/O	0
Rachetées au cours de l'exercice	S/O	(1)
	S/O	(1)
Catégorie Z :		
Capitalisation		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	0	0

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	5 022	4 410
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(3 722)	(1 590)
	1 300	2 820
Distribution		
Émises	183	169
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	45
Rachetées au cours de l'exercice	(105)	(292)
	78	(78)
	Fonds US High Yield Bond Fund	
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	4 125	18 555
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(23 143)	(35 432)
	(19 018)	(16 877)
Distribution		
Émises	1 227	13 184
Émises à partir du réinvestissement des distributions	158	212
Rachetées au cours de l'exercice	(13 176)	(5 260)
	(11 791)	8 136
Institutions en CHF (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	22	122
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(244)	(118)
	(222)	4
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	2 175	8 803
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(8 534)	(3 328)
	(6 359)	5 475
Distribution		
Émises	669	1 391
Émises à partir du réinvestissement des distributions	303	278
Rachetées au cours de l'exercice	(9 203)	(493)
	(8 231)	1 176
Institutions en GBP (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	196	268
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(292)	(68)
	(96)	200
Distribution		
Émises	63	254
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(447)	(463)
	(384)	(209)
Institutions en SGD (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	15	37
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(52)	0
	(37)	37

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
	Fonds US High Yield Bond Fund (suite)	
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	485	5 051
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(4 966)	(1 917)
	(4 481)	3 134
Distribution		
Émises	448	1 582
Émises à partir du réinvestissement des distributions	31	27
Rachetées au cours de l'exercice	(1 987)	(925)
	(1 508)	684
Investisseurs en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	495	21
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(495)	(48)
	0	(27)
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	853	2 535
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(2 926)	(2 107)
	(2 073)	428
Distribution		
Émises	5 181	16 026
Émises à partir du réinvestissement des distributions	70	64
Rachetées au cours de l'exercice	(10 275)	(14 086)
	(5 024)	2 004
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	1 163	716
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 564)	(1 070)
	(401)	(354)
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	6 232	6 031
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(7 216)	(5 457)
	(984)	574
Distribution		
Émises	31	90
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	0
Rachetées au cours de l'exercice	(70)	(1)
	(38)	89
M Détail :		
Distribution		
Émises	12 039	14 553
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	(11 070)	(14 913)
	970	(359)
Catégorie R :		
Capitalisation		
Émises	319	56
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(236)	(66)
	83	(10)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds US High Yield Bond Fund (suite)		
Catégorie Z :		
Capitalisation		
Émises	0	0
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	0	0
	0	0
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	10 490	4 087
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(6 644)	(12 841)
	3 846	(8 754)
Distribution		
Émises	2 630	2 579
Émises à partir du réinvestissement des distributions	3	3
Rachetées au cours de l'exercice	(1 431)	(4 935)
	1 202	(2 353)
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	6 790	18 089
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(12 251)	(22 965)
	(5 461)	(4 876)
Institutions en GBP (couverte) :		
Distribution II		
Émises	840	1 207
Émises à partir du réinvestissement des distributions	283	1 027
Rachetées au cours de l'exercice	(30 818)	(3 747)
	(29 695)	(1 513)
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	1 086	492
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(249)	(1 328)
	837	(836)
Distribution		
Émises	111	216
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1	1
Rachetées au cours de l'exercice	(279)	(644)
	(167)	(427)
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	6	S/O
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	S/O
Rachetées au cours de l'exercice	0	S/O
	6	S/O
Fonds US Short-Term Fund		
Institutions :		
Capitalisation		
Émises	73 837	49 749
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(71 198)	(114 398)
	2 639	(64 649)

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021
Fonds US Short-Term Fund (suite)		
Distribution		
Émises	3 299	2 619
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(264)	(11 890)
	3 035	(9 271)
Institutions en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	16 072	16 010
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(18 694)	(17 952)
	(2 622)	(1 942)
Investisseurs :		
Capitalisation		
Émises	174	704
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(681)	(978)
	(507)	(274)
Catégorie E :		
Capitalisation		
Émises	15 967	20 241
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(20 780)	(28 234)
	(4 813)	(7 993)
Catégorie E en EUR (couverte) :		
Capitalisation		
Émises	4 393	137
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(681)	(401)
	3 712	(264)
H Institutions :		
Capitalisation		
Émises	840	4 940
Émises à partir du réinvestissement des distributions	0	0
Rachetées au cours de l'exercice	(1 943)	(3 084)
	(1 103)	1 856
Catégorie Z :		
Distribution		
Émises	690	1 480
Émises à partir du réinvestissement des distributions	1 338	932
Rachetées au cours de l'exercice	(32 194)	(6 347)
	(30 166)	(3 935)

19. VALEURS NETTES D'INVENTAIRE

L'actif net attribuable aux porteurs d'actions de participation rachetables, les actions émises en circulation, ainsi que la Valeur Nette d'Inventaire par action de chacun des Fonds pour les trois derniers exercices sont les suivants (les montants sont en milliers, sauf les montants par action). La Valeur Nette d'Inventaire par action divulguée dans ces états financiers peut comprendre des ajustements exigés par la norme FRS 102, ce qui peut avoir pour conséquence que la Valeur Nette d'Inventaire des actionnaires ou les rendements totaux peuvent différer de ceux publiés dans les présents états financiers. L'actif net divisé par le nombre d'actions émises en circulation peut ne pas être égal à la VNI par action en raison des arrondis :

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund			
Actif net	$ 2 981 392	$ 3 411 923	$ 890 928
Institutions :			
Capitalisation	$ 1 552 047	$ 1 221 240	$ 265 889
Actions émises en circulation	174 453	117 953	23 044
VNI par action	$ 8,90	$ 10,35	$ 11,54

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (suite)		
Distribution	$ 113 734	$ 248 734	$ 43 289
Actions émises en circulation	16 032	28 125	4 163
VNI par action	$ 7,09	$ 8,84	$ 10,40
Institutions en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 203 422	AUD 12	S/O
Actions émises en circulation	28 372	1	S/O
VNI par action	AUD 7,17	AUD 9,00	S/O
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 4 094	CHF 35 166	CHF 6 108
Actions émises en circulation	527	3 797	586
VNI par action	CHF 7,77	CHF 9,26	CHF 10,43
Distribution	CHF 1 912	CHF 5 135	CHF 860
Actions émises en circulation	281	591	83
VNI par action	CHF 6,81	CHF 8,69	CHF 10,32
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 498 977	€ 653 189	€ 38 336
Actions émises en circulation	63 739	70 200	3 662
VNI par action	€ 7,83	€ 9,30	€ 10,47
Distribution	€ 27 728	€ 75 650	€ 11 559
Actions émises en circulation	4 056	8 695	1 120
VNI par action	€ 6,84	€ 8,70	€ 10,32
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 14 369	£ 18 246	S/O
Actions émises en circulation	1 836	1 996	S/O
VNI par action	£ 7,83	£ 9,14	S/O
Distribution	£ 20 785	£ 59 979	S/O
Actions émises en circulation	3 068	7 061	S/O
VNI par action	£ 6,77	£ 8,50	S/O
Institutions en RMB (couverte) :			
Distribution	S/O	CNH 61	S/O
Actions émises en circulation	S/O	1	S/O
VNI par action	S/O	CNH 91,17	S/O
Institutions en SGD (couverte) :			
Distribution	SGD 385	SGD 85	S/O
Actions émises en circulation	53	9	S/O
VNI par action	SGD 7,23	SGD 9,01	S/O
Investisseurs :			
Capitalisation	$ 8 727	$ 19 282	S/O
Actions émises en circulation	1 164	2 201	S/O
VNI par action	$ 7,50	$ 8,76	S/O
Distribution	$ 71 688	$ 273 632	$ 66 319
Actions émises en circulation	10 304	31 566	6 506
VNI par action	$ 6,96	$ 8,67	$ 10,19
Investisseurs en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 3 889	AUD 5 081	AUD 366
Actions émises en circulation	557	579	35
VNI par action	AUD 6,99	AUD 8,77	AUD 10,34
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Distribution	€ 873	€ 935	€ 226
Actions émises en circulation	130	110	22
VNI par action	€ 6,69	€ 8,52	€ 10,11
Investisseurs en RMB (couverte) :			
Distribution	CNH 13 234	CNH 24 873	CNH 8 387
Actions émises en circulation	182	275	81
VNI par action	CNH 72,74	CNH 90,46	CNH 103,59
Investisseurs en SGD (couverte) :			
Distribution	SGD 4 112	SGD 6 528	SGD 1 175
Actions émises en circulation	591	753	115
VNI par action	SGD 6,96	SGD 8,67	SGD 10,19

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (suite)		
Administrations :			
Distribution	$ 28 245	$ 41 320	$ 18 459
Actions émises en circulation	3 980	4 672	1 775
VNI par action	$ 7,10	$ 8,84	$ 10,40
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 61 585	$ 78 405	$ 6 725
Actions émises en circulation	7 540	8 175	624
VNI par action	$ 8,17	$ 9,59	$ 10,79
Distribution	$ 56 633	$ 100 159	$ 25 374
Actions émises en circulation	7 981	11 325	2 440
VNI par action	$ 7,10	$ 8,84	$ 10,40
Catégorie E en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 1 012	CHF 1 263	CHF 89
Actions émises en circulation	133	138	9
VNI par action	CHF 7,63	CHF 9,16	CHF 10,41
Distribution	CHF 245	CHF 280	CHF 31
Actions émises en circulation	36	32	3
VNI par action	CHF 6,81	CHF 8,69	CHF 10,33
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 48 877	€ 61 580	€ 20 246
Actions émises en circulation	6 365	6 687	1 938
VNI par action	€ 7,68	€ 9,21	€ 10,45
Distribution	€ 8 314	€ 10 041	€ 1 020
Actions émises en circulation	1 217	1 154	99
VNI par action	€ 6,83	€ 8,70	€ 10,32
Catégorie E en HKD (non couverte) :			
Distribution	HKD 6 334	HKD 4 540	HKD 2 458
Actions émises en circulation	897	516	239
VNI par action	HKD 7,06	HKD 8,79	HKD 10,28
Catégorie E en SGD (couverte) :			
Distribution	SGD 15 239	SGD 25 623	SGD 12 464
Actions émises en circulation	2 168	2 924	1 211
VNI par action	SGD 7,03	SGD 8,76	SGD 10,29
H Institutions :			
Capitalisation	$ 1 323	$ 182	S/O
Actions émises en circulation	172	20	S/O
VNI par action	$ 7,69	$ 8,96	S/O
Distribution	$ 547	$ 686	S/O
Actions émises en circulation	79	80	S/O
VNI par action	$ 6,90	$ 8,60	S/O
M Détail :			
Distribution II	$ 17 613	$ 22 700	$ 12 308
Actions émises en circulation	2 637	2 684	1 219
VNI par action	$ 6,68	$ 8,46	$ 10,10
M Détail en HKD (non couverte) :			
Distribution II	HKD 1 797	HKD 6 482	HKD 1 567
Actions émises en circulation	270	771	157
VNI par action	HKD 6,65	HKD 8,41	HKD 9,98
M Détail en SGD (couverte) :			
Distribution II	SGD 8 881	SGD 11 492	SGD 7 080
Actions émises en circulation	1 342	1 372	708
VNI par action	SGD 6,62	SGD 8,38	SGD 10,00
Catégorie Z :			
Capitalisation	$ 230 136	$ 300 885	$ 339 431
Actions émises en circulation	25 207	28 503	29 046
VNI par action	$ 9,13	$ 10,56	$ 11,69
	Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund		
Actif net	$ 313 987	$ 361 011	$ 167 716
Institutions :			
Distribution	$ 54 459	$ 64 997	$ 3 652
Actions émises en circulation	6 776	6 958	362
VNI par action	$ 8,04	$ 9,34	$ 10,10

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund (suite)						
Institutions en EUR (couverte) :						
Distribution	€	97 916	€	102 975		S/O
Actions émises en circulation		12 495		11 068		S/O
VNI par action	€	7,84	€	9,30		S/O
Institutions en GBP (couverte) :						
Distribution	£	205	£	174		S/O
Actions émises en circulation		26		19		S/O
VNI par action	£	8,04	£	9,41		S/O
Institutions en SGD (couverte) :						
Distribution	SGD	3 799	SGD	5 354	SGD	4 213
Actions émises en circulation		467		566		412
VNI par action	SGD	8,13	SGD	9,46	SGD	10,22
Catégorie E :						
Capitalisation	$	806	$	12	$	10
Actions émises en circulation		94		1		1
VNI par action	$	8,62	$	9,69	$	10,19
Distribution	$	24 409	$	24 934	$	23 579
Actions émises en circulation		3 450		3 015		2 605
VNI par action	$	7,08	$	8,27	$	9,05
Catégorie E en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	5 640	€	5 060		S/O
Actions émises en circulation		680		532		S/O
VNI par action	€	8,29	€	9,51		S/O
Catégorie E en EUR (non couverte) :						
Capitalisation	€	21 244	€	25 443	€	14 254
Actions émises en circulation		1 500		1 703		976
VNI par action	€	14,17	€	14,94	€	14,60
Catégorie E en HKD (non couverte) :						
Distribution	HKD	2 973	HKD	3 401	HKD	79
Actions émises en circulation		367		362		8
VNI par action	HKD	8,09	HKD	9,40	HKD	10,10
Catégorie E en SGD (couverte) :						
Distribution	SGD	300	SGD	337	SGD	355
Actions émises en circulation		37		36		35
VNI par action	SGD	8,13	SGD	9,46	SGD	10,22
M Détail en HKD (non couverte) :						
Distribution	HKD	31 879	HKD	39 857	HKD	49 317
Actions émises en circulation		5 174		5 540		6 298
VNI par action	HKD	6,16	HKD	7,19	HKD	7,83
Catégorie Z :						
Capitalisation	$	93 351	$	109 270	$	113 208
Actions émises en circulation		10 610		11 219		11 220
VNI par action	$	8,80	$	9,74	$	10,09
Fonds PIMCO Capital Securities Fund						
Actif net	$	5 721 591	$	9 110 409	$	7 958 322
Institutions :						
Capitalisation	$	1 352 729	$	2 296 596	$	1 983 832
Actions émises en circulation		69 143		103 846		94 295
VNI par action	$	19,56	$	22,12	$	21,04
Distribution	$	393 584	$	728 260	$	435 050
Actions émises en circulation		39 825		62 402		37 992
VNI par action	$	9,88	$	11,67	$	11,45
Institutions en AUD (couverte) :						
Distribution		S/O	AUD	14		S/O
Actions émises en circulation		S/O		1		S/O
VNI par action		S/O	AUD	9,90		S/O
Institutions en BRL (couverte) :						
Capitalisation	$	25 163	$	47 342	$	8 585
Actions émises en circulation		3 040		5 855		1 079
VNI par action	$	8,28	$	8,09	$	7,96

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)						
Institutions en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	52 485	CHF	120 911	CHF	51 534
Actions émises en circulation		3 478		6 908		3 064
VNI par action	CHF	15,09	CHF	17,50	CHF	16,82
Institutions en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	1 198 101	€	1 868 333	€	1 661 782
Actions émises en circulation		88 171		118 946		110 286
VNI par action	€	13,59	€	15,71	€	15,07
Distribution	€	383 951	€	481 884	€	487 278
Actions émises en circulation		36 928		38 373		39 195
VNI par action	€	10,40	€	12,56	€	12,43
Distribution II	€	31 417	€	41 671	€	26 473
Actions émises en circulation		3 979		4 334		2 760
VNI par action	€	7,89	€	9,61	€	9,59
Institutions en GBP (couverte) :						
Capitalisation	£	35 494	£	43 301	£	37 603
Actions émises en circulation		2 518		2 696		2 455
VNI par action	£	14,10	£	16,06	£	15,32
Distribution	£	67 663	£	106 976	£	127 724
Actions émises en circulation		6 132		8 135		9 873
VNI par action	£	11,03	£	13,15	£	12,94
Institutions en RMB (couverte) :						
Distribution		S/O	CNH	66		S/O
Actions émises en circulation		S/O		1		S/O
VNI par action		S/O	CNH	100,31		S/O
Institutions en SGD (couverte) :						
Distribution	SGD	178	SGD	39		S/O
Actions émises en circulation		21		4		S/O
VNI par action	SGD	8,38	SGD	9,91		S/O
Investisseurs :						
Capitalisation	$	215 127	$	345 234	$	237 400
Actions émises en circulation		16 173		22 879		16 481
VNI par action	$	13,30	$	15,09	$	14,40
Distribution	$	72 649	$	245 968	$	202 032
Actions émises en circulation		7 387		21 180		17 730
VNI par action	$	9,84	$	11,61	$	11,39
Investisseurs en AUD (couverte) :						
Distribution	AUD	12 971	AUD	26 915	AUD	26 186
Actions émises en circulation		1 437		2 496		2 467
VNI par action	AUD	9,03	AUD	10,79	AUD	10,62
Investisseurs en CAD (couverte) :						
Distribution	CAD	4 043	CAD	4 771	CAD	546
Actions émises en circulation		432		431		50
VNI par action	CAD	9,35	CAD	11,08	CAD	10,89
Investisseurs en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	23 367	€	49 337	€	37 573
Actions émises en circulation		1 978		3 601		2 848
VNI par action	€	11,81	€	13,70	€	13,19

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)			
Investisseurs en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 2 695	£ 3 470	£ 2 096
Actions émises en circulation	319	344	211
VNI par action	£ 8,46	£ 10,08	£ 9,92
Investisseurs en RMB (couverte) :			
Distribution	CNH 31 763	CNH 39 482	CNH 37 405
Actions émises en circulation	313	330	327
VNI par action	CNH 101,51	CNH 119,51	CNH 114,26
Investisseurs en SGD (couverte) :			
Distribution	SGD 5 849	SGD 5 321	SGD 4 726
Actions émises en circulation	630	484	438
VNI par action	SGD 9,29	SGD 10,99	SGD 10,78
Administrations :			
Capitalisation	$ 141 400	$ 149 168	$ 193 489
Actions émises en circulation	7 599	7 057	9 574
VNI par action	$ 18,61	$ 21,14	$ 20,21
Distribution	$ 98 383	$ 140 861	$ 137 606
Actions émises en circulation	7 402	8 978	8 938
VNI par action	$ 13,29	$ 15,69	$ 15,39
Distribution II	$ 10	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	$ 9,60	S/O	S/O
Administrations en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 13 449	€ 18 966	€ 20 552
Actions émises en circulation	843	1 024	1 150
VNI par action	€ 15,95	€ 18,53	€ 17,87
Administrations en SGD (couverte) :			
Distribution II	SGD 14	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	SGD 9,59	S/O	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 352 622	$ 452 418	$ 406 039
Actions émises en circulation	25 798	29 018	27 132
VNI par action	$ 13,67	$ 15,59	$ 14,97
Distribution	$ 64 556	$ 99 264	$ 84 704
Actions émises en circulation	6 556	8 539	7 426
VNI par action	$ 9,85	$ 11,62	$ 11,41
Catégorie E en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 8 252	CHF 11 446	CHF 9 397
Actions émises en circulation	793	940	796
VNI par action	CHF 10,41	CHF 12,18	CHF 11,81
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 402 295	€ 497 935	€ 465 125
Actions émises en circulation	34 146	36 232	34 965
VNI par action	€ 11,78	€ 13,74	€ 13,30
Distribution	€ 62 789	€ 73 090	€ 62 905
Actions émises en circulation	7 332	7 069	6 146
VNI par action	€ 8,56	€ 10,34	€ 10,23
M Détail :			
Distribution II	$ 218 883	$ 306 306	$ 218 504
Actions émises en circulation	24 922	29 067	20 788
VNI par action	$ 8,78	$ 10,54	$ 10,51
M Détail en HKD (non couverte) :			
Distribution	HKD 2 801	HKD 24 499	HKD 23 223
Actions émises en circulation	298	2 211	2 148
VNI par action	HKD 9,40	HKD 11,08	HKD 10,81
M Détail en SGD (couverte) :			
Distribution II	SGD 100 715	SGD 145 278	SGD 67 688
Actions émises en circulation	11 653	13 981	6 533
VNI par action	SGD 8,64	SGD 10,39	SGD 10,36

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds PIMCO Capital Securities Fund (suite)			
Catégorie R :			
Distribution	$ 4 980	$ 6 177	$ 5 913
Actions émises en circulation	501	526	514
VNI par action	$ 9,94	$ 11,73	$ 11,51
Catégorie R en EUR (couverte) :			
Distribution	€ 3 708	€ 12 422	€ 9 666
Actions émises en circulation	445	1 233	970
VNI par action	€ 8,33	€ 10,07	€ 9,97
Catégorie R en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 2 795	£ 5 957	£ 6 265
Actions émises en circulation	315	564	603
VNI par action	£ 8,86	£ 10,56	£ 10,39
Catégorie T :			
Distribution	$ 8 517	$ 11 570	$ 10 970
Actions émises en circulation	839	966	933
VNI par action	$ 10,15	$ 11,98	$ 11,75
Catégorie T en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 65 092	€ 84 896	€ 68 823
Actions émises en circulation	6 106	6 800	5 673
VNI par action	€ 10,66	€ 12,48	€ 12,13
Catégorie Z :			
Distribution	$ 78 203	$ 124 585	$ 71 902
Actions émises en circulation	7 202	9 705	5 708
VNI par action	$ 10,86	$ 12,84	$ 12,60
Catégorie Z en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 104 790	AUD 127 724	AUD 125 272
Actions émises en circulation	11 002	11 223	11 181
VNI par action	AUD 9,52	AUD 11,38	AUD 11,20
Fonds PIMCO Climate Bond Fund			
Actif net	$ 292 655	$ 328 081	$ 101 869
Institutions :			
Capitalisation	$ 27 502	$ 21 317	$ 4 565
Actions émises en circulation	3 116	2 108	449
VNI par action	$ 8,83	$ 10,11	$ 10,17
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 940	CHF 1 103	CHF 231
Actions émises en circulation	112	111	23
VNI par action	CHF 8,42	CHF 9,91	CHF 10,06
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 62 757	€ 80 658	€ 16 688
Actions émises en circulation	7 351	8 066	1 646
VNI par action	€ 8,54	€ 10,00	€ 10,14
Distribution	€ 73 780	€ 101 819	€ 60 190
Actions émises en circulation	8 951	10 361	5 992
VNI par action	€ 8,24	€ 9,83	€ 10,05
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 32 441	£ 28 217	£ 1 717
Actions émises en circulation	3 720	2 799	169
VNI par action	£ 8,72	£ 10,08	£ 10,15
Distribution	£ 25 204	£ 715	S/O
Actions émises en circulation	2 978	72	S/O
VNI par action	£ 8,46	£ 9,97	S/O
Institutions en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 290 215	SEK 292 047	S/O
Actions émises en circulation	3 406	2 939	S/O
VNI par action	SEK 85,22	SEK 99,36	S/O
Institutions en SGD (couverte) :			
Capitalisation	SGD 5 576	SGD 5 453	S/O
Actions émises en circulation	635	541	S/O
VNI par action	SGD 8,78	SGD 10,08	S/O

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
Fonds PIMCO Climate Bond Fund (suite)						
Investisseurs :						
Capitalisation		S/O	$	3 214		S/O
Actions émises en circulation		S/O		321		S/O
VNI par action		S/O	$	10,00		S/O
Investisseurs en EUR (couverte) :						
Capitalisation		S/O	€	8		S/O
Actions émises en circulation		S/O		1		S/O
VNI par action		S/O	€	9,92		S/O
Administrations en SEK (couverte) :						
Capitalisation	SEK	73	SEK	86		S/O
Actions émises en circulation		1		1		S/O
VNI par action	SEK	84,84	SEK	99,39		S/O
Catégorie E en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	15 976	€	16 979	€	507
Actions émises en circulation		1 909		1 718		50
VNI par action	€	8,37	€	9,88	€	10,11
Catégorie Z :						
Capitalisation	$	9	$	10	$	10
Actions émises en circulation		1		1		1
VNI par action	$	8,93	$	10,18	$	10,18
Fonds Commodity Real Return Fund						
Actif net	$	1 369 877	$	1 444 182	$	325 109
Institutions :						
Capitalisation	$	397 781	$	587 333	$	162 906
Actions émises en circulation		41 220		67 481		24 677
VNI par action	$	9,65	$	8,70	$	6,60
Institutions en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	225 302	€	144 220	€	31 294
Actions émises en circulation		23 996		16 678		4 723
VNI par action	€	9,39	€	8,65	€	6,63
Institutions en EUR (non couverte) :						
Capitalisation	€	87 086	€	48 990		S/O
Actions émises en circulation		6 527		4 337		S/O
VNI par action	€	13,34	€	11,29		S/O
Institutions en GBP (couverte) :						
Capitalisation	£	39 019	£	36 172	£	14 663
Actions émises en circulation		2 963		3 012		1 597
VNI par action	£	13,17	£	12,01	£	9,18
Institutions en GBP (non couverte) :						
Distribution	£	17 587		S/O		S/O
Actions émises en circulation		1 881		S/O		S/O
VNI par action	£	9,35		S/O		S/O
Investisseurs :						
Capitalisation	$	50 111	$	64 377	$	10 609
Actions émises en circulation		6 022		8 546		1 851
VNI par action	$	8,32	$	7,53	$	5,73
Catégorie E :						
Capitalisation	$	260 353	$	256 747	$	66 707
Actions émises en circulation		33 734		36 552		12 411
VNI par action	$	7,72	$	7,02	$	5,37
Catégorie E en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	238 920	€	234 570	€	21 703
Actions émises en circulation		33 254		35 127		4 204
VNI par action	€	7,18	€	6,68	€	5,16
Catégorie E en SGD (couverte) :						
Capitalisation	SGD	2 069	SGD	352		S/O
Actions émises en circulation		183		34		S/O
VNI par action	SGD	11,30	SGD	10,32		S/O
H Institutions :						
Capitalisation	$	3 614		S/O		S/O
Actions émises en circulation		427		S/O		S/O
VNI par action	$	8,46		S/O		S/O

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund						
Actif net	$	97 153	$	139 704	$	144 512
Institutions :						
Capitalisation	$	44 986	$	47 099	$	46 003
Actions émises en circulation		3 318		3 345		3 308
VNI par action	$	13,56	$	14,07	$	13,91
Institutions en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	15 367	CHF	22 488	CHF	22 715
Actions émises en circulation		1 500		2 060		2 084
VNI par action	CHF	10,24	CHF	10,92	CHF	10,90
Institutions en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	15 443	€	39 139	€	41 292
Actions émises en circulation		1 312		3 136		3 320
VNI par action	€	11,77	€	12,48	€	12,44
Catégorie E :						
Capitalisation	$	8 985	$	9 740	$	8 496
Actions émises en circulation		803		831		726
VNI par action	$	11,20	$	11,73	$	11,70
Catégorie E en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	9 455	€	12 026	€	11 273
Actions émises en circulation		971		1 154		1 075
VNI par action	€	9,74	€	10,42	€	10,48
Fonds Diversified Income Fund						
Actif net	$	8 751 796	$	16 447 733	$	18 641 861
Institutions :						
Capitalisation	$	824 847	$	1 243 637	$	1 066 263
Actions émises en circulation		35 047		44 236		37 907
VNI par action	$	23,54	$	28,11	$	28,13
Distribution	$	352 231	$	692 397	$	830 361
Actions émises en circulation		27 897		44 132		51 315
VNI par action	$	12,63	$	15,69	$	16,18
Institutions en CAD (couverte) :						
Capitalisation	CAD	441 412	CAD	571 190	CAD	423 593
Actions émises en circulation		45 218		48 824		36 151
VNI par action	CAD	9,76	CAD	11,70	CAD	11,72
Institutions en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	15 646	CHF	20 277	CHF	19 775
Actions émises en circulation		1 299		1 371		1 322
VNI par action	CHF	12,04	CHF	14,79	CHF	14,96
Distribution	CHF	8 022	CHF	13 028	CHF	19 392
Actions émises en circulation		1 111		1 412		2 014
VNI par action	CHF	7,22	CHF	9,23	CHF	9,63
Institutions en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	998 452	€	1 703 682	€	1 697 782
Actions émises en circulation		65 216		90 940		89 784
VNI par action	€	15,31	€	18,73	€	18,91
Distribution	€	330 342	€	852 032	€	933 208
Actions émises en circulation		42 647		86 306		90 802
VNI par action	€	7,75	€	9,87	€	10,28
Institutions en GBP (couverte) :						
Capitalisation	£	572 158	£	1 248 141	£	1 623 041
Actions émises en circulation		44 993		81 268		105 382
VNI par action	£	12,72	£	15,36	£	15,40

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
Fonds Diversified Income Fund (suite)						
Distribution	£	391 080	£	601 893	£	1 020 119
Actions émises en circulation		67 375		81 620		133 743
VNI par action	£	5,80	£	7,37	£	7,63
Institutions en MXN (couverte) :						
Capitalisation	MXN	270 310	MXN	299 232	MXN	5 392
Actions émises en circulation		2 863		2 831		53
VNI par action	MXN	94,40	MXN	105,70	MXN	101,13
Institutions en SEK (couverte) :						
Capitalisation	SEK	168 340	SEK	205 009	SEK	258 455
Actions émises en circulation		1 058		1 057		1 325
VNI par action	SEK	159,10	SEK	193,88	SEK	195,03
Institutions en SGD (couverte) :						
Distribution	SGD	43 716	SGD	79 938	SGD	30 850
Actions émises en circulation		5 366		7 873		2 946
VNI par action	SGD	8,15	SGD	10,15	SGD	10,47
Investisseurs :						
Capitalisation	$	53 597	$	83 045	$	63 761
Actions émises en circulation		4 492		5 806		4 440
VNI par action	$	11,93	$	14,30	$	14,36
Distribution	$	89 559	$	69 026	$	43 507
Actions émises en circulation		10 495		6 522		3 986
VNI par action	$	8,53	$	10,58	$	10,92
Investisseurs en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	21 418	€	34 903	€	29 190
Actions émises en circulation		1 477		1 960		1 618
VNI par action	€	14,50	€	17,81	€	18,04
Distribution	€	10 066	€	11 743	€	8 787
Actions émises en circulation		1 375		1 260		905
VNI par action	€	7,32	€	9,32	€	9,70
Administrations :						
Distribution	$	87 885	$	143 334	$	144 682
Actions émises en circulation		9 431		12 385		12 123
VNI par action	$	9,32	$	11,57	$	11,94
Administrations en AUD (couverte) :						
Distribution	AUD	2 794	AUD	3 812	AUD	4 404
Actions émises en circulation		341		370		413
VNI par action	AUD	8,18	AUD	10,30	AUD	10,65
Administrations en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	4 330	€	10 014	€	12 496
Actions émises en circulation		306		575		707
VNI par action	€	14,16	€	17,42	€	17,67
Administrations en GBP (couverte) :						
Distribution	£	8 358	£	12 610	£	11 699
Actions émises en circulation		972		1 168		1 048
VNI par action	£	8,60	£	10,80	£	11,17
Administrations en JPY (couverte) :						
Capitalisation	¥	354 957	¥	47 222		S/O
Actions émises en circulation		438		47		S/O
VNI par action	¥	811,00	¥	1 002,00		S/O
Administrations en SEK (couverte) :						
Capitalisation	SEK	78	SEK	84	SEK	85
Actions émises en circulation		1		1		1
VNI par action	SEK	80,78	SEK	98,94	SEK	100,08
Administrations en SGD (couverte) :						
Distribution	SGD	55 693	SGD	101 850	SGD	136 614
Actions émises en circulation		6 640		9 757		12 691
VNI par action	SGD	8,39	SGD	10,44	SGD	10,76
BM Détail :						
Distribution II	$	9		S/O		S/O
Actions émises en circulation		1		S/O		S/O
VNI par action	$	9,17		S/O		S/O
BN Détail :						
Distribution II	$	9		S/O		S/O
Actions émises en circulation		1		S/O		S/O
VNI par action	$	9,17		S/O		S/O

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
Fonds Diversified Income Fund (suite)						
Catégorie E :						
Capitalisation	$	655 637	$	1 113 069	$	1 457 105
Actions émises en circulation		32 342		45 554		59 069
VNI par action	$	20,27	$	24,43	$	24,67
Distribution	$	372 507	$	630 798	$	808 596
Actions émises en circulation		33 038		45 041		55 978
VNI par action	$	11,28	$	14,01	$	14,44
Catégorie E en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	7 655	CHF	9 701	CHF	7 607
Actions émises en circulation		918		939		721
VNI par action	CHF	8,34	CHF	10,33	CHF	10,55
Catégorie E en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	1 292 425	€	1 880 735	€	1 798 793
Actions émises en circulation		96 369		113 579		106 656
VNI par action	€	13,41	€	16,56	€	16,87
Distribution	€	781 155	€	1 366 978	€	1 638 721
Actions émises en circulation		88 377		121 500		139 927
VNI par action	€	8,84	€	11,25	€	11,71
Catégorie E en SGD (couverte) :						
Distribution	SGD	22 377	SGD	47 272	SGD	83 189
Actions émises en circulation		2 757		4 674		7 977
VNI par action	SGD	8,12	SGD	10,11	SGD	10,43
H Institutions :						
Capitalisation	$	385 630	$	1 501 526	$	1 307 826
Actions émises en circulation		21 717		70 674		61 420
VNI par action	$	17,76	$	21,25	$	21,29
Distribution	$	118	$	26	$	27
Actions émises en circulation		14		2		2,00
VNI par action	$	8,61	$	10,70	$	11,04
M Détail :						
Distribution	$	150 260	$	246 412	$	348 905
Actions émises en circulation		15 573		20 577		28 250
VNI par action	$	9,65	$	11,98	$	12,35
Distribution II	$	183 635	$	311 977	$	452 614
Actions émises en circulation		23 717		31 930		44 209
VNI par action	$	7,74	$	9,77	$	10,24
M Détail en AUD (couverte) :						
Distribution	AUD	49 591	AUD	83 307	AUD	148 786
Actions émises en circulation		5 574		7 442		12 851
VNI par action	AUD	8,90	AUD	11,19	AUD	11,58
M Détail en SGD (couverte) :						
Distribution II		S/O	SGD	13		S/O
Actions émises en circulation		S/O		1		S/O
VNI par action		S/O	SGD	9,82		S/O
N Détail :						
Distribution II	$	9	$	10	$	10
Actions émises en circulation		1		1		1
VNI par action	$	8,61	$	10,38	$	10,48
Catégorie T :						
Capitalisation	$	25 356	$	40 854	$	31 960
Actions émises en circulation		2 318		3 086		2 382
VNI par action	$	10,94	$	13,24	$	13,42

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds Diversified Income Fund (suite)		
Distribution	$ 6 829	$ 9 630	$ 9 265
Actions émises en circulation	771	876	817
VNI par action	$ 8,85	$ 11,00	$ 11,34
Catégorie T en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 36 445	€ 53 705	€ 56 537
Actions émises en circulation	3 883	4 616	4 752
VNI par action	€ 9,38	€ 11,63	€ 11,90
Distribution	€ 19 507	€ 28 295	€ 35 099
Actions émises en circulation	2 576	2 937	3 500
VNI par action	€ 7,57	€ 9,63	€ 10,03
Catégorie W :			
Capitalisation	$ 64 400	$ 120 525	$ 46 301
Actions émises en circulation	7 380	11 579	4 453
VNI par action	$ 8,73	$ 10,41	$ 10,40
Distribution	$ 45 458	$ 137 527	$ 36 531
Actions émises en circulation	5 672	13 806	3 555
VNI par action	$ 8,01	$ 9,96	$ 10,28
Catégorie W en CAD (couverte) :			
Capitalisation	S/O	CAD 14	CAD 14
Actions émises en circulation	S/O	1	1
VNI par action	S/O	CAD 10,38	CAD 10,39
Catégorie W en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 10 994	CHF 13 719	CHF 12 711
Actions émises en circulation	1 317	1 339	1 229
VNI par action	CHF 8,35	CHF 10,24	CHF 10,35
Distribution	CHF 699	CHF 1 588	CHF 10
Actions émises en circulation	91	162	1
VNI par action	CHF 7,67	CHF 9,80	CHF 10,23
Catégorie W en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 11 937	€ 15 286	€ 10 643
Actions émises en circulation	1 420	1 488	1 028
VNI par action	€ 8,40	€ 10,27	€ 10,35
Distribution	€ 3 382	€ 6 737	€ 7 733
Actions émises en circulation	438	685	756
VNI par action	€ 7,72	€ 9,83	€ 10,23
Catégorie W en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 2 089	£ 2 371	£ 420
Actions émises en circulation	243	229	40
VNI par action	£ 8,59	£ 10,36	£ 10,38
Distribution	£ 2 895	£ 3 547	£ 767
Actions émises en circulation	367	358	75
VNI par action	£ 7,89	£ 9,92	£ 10,26
Catégorie W en SGD (couverte) :			
Distribution	SGD 3 079	SGD 4 762	SGD 3 397
Actions émises en circulation	385	477	330
VNI par action	SGD 8,00	SGD 9,97	SGD 10,28
	Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund		
Actif net	$ 564 684	$ 1 305 365	$ 1 486 931
Institutions :			
Capitalisation	$ 23 243	$ 64 311	$ 30 325
Actions émises en circulation	1 617	4 288	2 073
VNI par action	$ 14,38	$ 15,00	$ 14,63

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund (suite)		
Distribution	S/O	$ 3 462	$ 2 258
Actions émises en circulation	S/O	326	212
VNI par action	S/O	$ 10,63	$ 10,65
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 87 225	€ 165 664	€ 96 172
Actions émises en circulation	6 863	12 228	7 219
VNI par action	€ 12,71	€ 13,55	€ 13,32
Distribution II	€ 9 995	€ 40 816	€ 41 836
Actions émises en circulation	1 372	5 012	5 045
VNI par action	€ 7,29	€ 8,14	€ 8,29
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 182 935	£ 312 905	£ 443 936
Actions émises en circulation	13 134	21 396	31 048
VNI par action	£ 13,93	£ 14,62	£ 14,30
Distribution	£ 63 760	£ 176 678	£ 238 667
Actions émises en circulation	7 894	19 855	26 610
VNI par action	£ 8,08	£ 8,90	£ 8,97
Investisseurs :			
Capitalisation	$ 5 125	$ 11 010	$ 10 807
Actions émises en circulation	428	878	880
VNI par action	$ 11,98	$ 12,54	$ 12,28
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 24 033	$ 46 891	$ 38 133
Actions émises en circulation	2 054	3 805	3 145
VNI par action	$ 11,70	$ 12,32	$ 12,13
Distribution	$ 33 306	$ 38 488	$ 28 229
Actions émises en circulation	3 579	3 808	2 785
VNI par action	$ 9,30	$ 10,11	$ 10,13
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 54 593	€ 184 920	€ 185 348
Actions émises en circulation	4 696	14 788	14 936
VNI par action	€ 11,63	€ 12,50	€ 12,41
Distribution	€ 18 931	€ 29 006	€ 39 600
Actions émises en circulation	2 511	3 466	4 678
VNI par action	€ 7,54	€ 8,37	€ 8,46
	Fonds Diversified Income ESG Fund		
Actif net	$ 9 854	S/O	S/O
Institutions :			
Capitalisation	$ 9 367	S/O	S/O
Actions émises en circulation	947	S/O	S/O
VNI par action	$ 9,89	S/O	S/O
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 226	S/O	S/O
Actions émises en circulation	23	S/O	S/O
VNI par action	€ 9,76	S/O	S/O
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 188	S/O	S/O
Actions émises en circulation	19	S/O	S/O
VNI par action	£ 9,83	S/O	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 10	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	$ 9,85	S/O	S/O
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 9	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	€ 9,73	S/O	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds Dynamic Bond Fund		
Actif net	$ 3 483 601	$ 3 277 997	$ 3 204 860
Institutions :			
Capitalisation	$ 470 460	$ 626 628	$ 533 694
Actions émises en circulation	34 671	42 473	36 253
VNI par action	$ 13,57	$ 14,75	$ 14,72
Distribution	$ 81 771	$ 100 397	$ 50 835
Actions émises en circulation	8 057	8 882	4 429
VNI par action	$ 10,15	$ 11,30	$ 11,48
Institutions en CAD (couverte) :			
Capitalisation	CAD 11 952	CAD 15 351	CAD 17 931
Actions émises en circulation	1 186	1 398	1 635
VNI par action	CAD 10,08	CAD 10,98	CAD 10,96
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 70 173	CHF 87 168	CHF 71 980
Actions émises en circulation	7 073	7 873	6 448
VNI par action	CHF 9,92	CHF 11,07	CHF 11,16
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 187 622	€ 348 406	€ 467 029
Actions émises en circulation	15 837	26 481	35 268
VNI par action	€ 11,85	€ 13,16	€ 13,24
Distribution	€ 11 318	€ 12 768	€ 10 018
Actions émises en circulation	1 283	1 272	974
VNI par action	€ 8,82	€ 10,04	€ 10,29
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 1 840 373	£ 887 562	£ 827 076
Actions émises en circulation	152 611	67 216	62 634
VNI par action	£ 12,06	£ 13,20	£ 13,20
Distribution	£ 94 155	£ 253 262	£ 242 182
Actions émises en circulation	10 906	26 086	24 507
VNI par action	£ 8,63	£ 9,71	£ 9,88
Institutions en NOK (couverte) :			
Capitalisation	NOK 4 066	NOK 131 604	NOK 137 483
Actions émises en circulation	337	9 965	10 428
VNI par action	NOK 12,07	NOK 13,21	NOK 13,18
Institutions en SEK (couverte) :			
Capitalisation	S/O	SEK 24 943	SEK 502 097
Actions émises en circulation	S/O	237	4 761
VNI par action	S/O	SEK 105,17	SEK 105,47
Investisseurs :			
Capitalisation	$ 46 677	$ 56 790	$ 52 628
Actions émises en circulation	4 069	4 537	4 199
VNI par action	$ 11,47	$ 12,52	$ 12,53
Distribution	$ 2 830	$ 3 932	$ 2 996
Actions émises en circulation	312	389	292
VNI par action	$ 9,08	$ 10,11	$ 10,27
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 2 013	€ 5 744	€ 3 373
Actions émises en circulation	200	512	298
VNI par action	€ 10,08	€ 11,23	€ 11,34
Administrations :			
Capitalisation	$ 21 094	$ 29 563	$ 31 246
Actions émises en circulation	1 659	2 128	2 242
VNI par action	$ 12,72	$ 13,90	$ 13,93
Administrations en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 1 170	€ 3 659	€ 4 758
Actions émises en circulation	105	295	379
VNI par action	€ 11,11	€ 12,40	€ 12,54
Administrations en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 61 257	SEK 81 744	SEK 96 229
Actions émises en circulation	597	718	838
VNI par action	SEK 102,58	SEK 113,88	SEK 114,77

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds Dynamic Bond Fund (suite)		
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 69 989	$ 92 812	$ 74 125
Actions émises en circulation	6 354	7 680	6 092
VNI par action	$ 11,01	$ 12,08	$ 12,17
Distribution	$ 14 979	$ 19 242	$ 19 575
Actions émises en circulation	1 615	1 862	1 866
VNI par action	$ 9,28	$ 10,33	$ 10,49
Catégorie E en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 8 868	CHF 10 761	CHF 11 815
Actions émises en circulation	1 000	1 078	1 164
VNI par action	CHF 8,86	CHF 9,98	CHF 10,15
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 73 068	€ 138 697	€ 104 878
Actions émises en circulation	6 936	11 750	8 748
VNI par action	€ 10,54	€ 11,80	€ 11,99
Catégorie E en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 3 354	£ 3 820	£ 3 947
Actions émises en circulation	318	328	336
VNI par action	£ 10,55	£ 11,65	£ 11,76
G Détail en EUR (couverte) :			
Distribution	€ 7 061	€ 8 905	€ 10 799
Actions émises en circulation	896	992	1 174
VNI par action	€ 7,88	€ 8,98	€ 9,20
H Institutions :			
Capitalisation	$ 11 541	$ 18 571	$ 4 868
Actions émises en circulation	1 135	1 677	440
VNI par action	$ 10,17	$ 11,08	$ 11,07
Distribution	$ 10	$ 11	$ 11
Actions émises en circulation	1	1	1
VNI par action	$ 9,12	$ 10,16	$ 10,32
Catégorie R :			
Capitalisation	$ 6 385	$ 7 736	$ 8 296
Actions émises en circulation	577	642	689
VNI par action	$ 11,07	$ 12,05	$ 12,03
Catégorie Z :			
Capitalisation	$ 6 683	$ 9 940	S/O
Actions émises en circulation	725	1 001	S/O
VNI par action	$ 9,22	$ 9,93	S/O
Catégorie Z en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 27 023	AUD 36 313	AUD 34 486
Actions émises en circulation	2 938	3 513	3 276
VNI par action	AUD 9,20	AUD 10,34	AUD 10,53
	Fonds Dynamic Multi-Asset Fund		
Actif net	€ 5 115 170	€ 7 635 950	€ 5 128 926
Institutions :			
Capitalisation	€ 1 644 656	€ 2 765 020	€ 2 129 409
Actions émises en circulation	137 719	198 997	153 874
VNI par action	€ 11,94	€ 13,89	€ 13,84
Distribution II	€ 158 729	€ 238 007	€ 251 480
Actions émises en circulation	14 419	18 212	18 963
VNI par action	€ 11,01	€ 13,07	€ 13,26
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 3 063	CHF 5 282	CHF 4 488
Actions émises en circulation	297	438	373
VNI par action	CHF 10,31	CHF 12,06	CHF 12,04
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 552 226	£ 576 557	£ 216 239
Actions émises en circulation	43 745	39 733	15 034
VNI par action	£ 12,62	£ 14,51	£ 14,38
Distribution	£ 33 675	£ 17 109	£ 610
Actions émises en circulation	3 025	1 337	48
VNI par action	£ 11,13	£ 12,79	£ 12,68

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund (suite)						
Institutions en ILS (couverte) :						
Capitalisation	ILS	4 206		S/O		S/O
Actions émises en circulation		423		S/O		S/O
VNI par action	ILS	9,93		S/O		S/O
Institutions en SGD (couverte) :						
Capitalisation	SGD	109 428	SGD	27 017		S/O
Actions émises en circulation		12 486		2 702		S/O
VNI par action	SGD	8,76	SGD	10,00		S/O
Institutions en USD (couverte) :						
Capitalisation	$	156 343	$	281 670	$	175 228
Actions émises en circulation		11 438		18 087		11 398
VNI par action	$	13,67	$	15,57	$	15,37
Distribution II	$	4 450	$	5 074		S/O
Actions émises en circulation		531		512		S/O
VNI par action	$	8,38	$	9,92		S/O
Investisseurs :						
Capitalisation	€	10 626	€	11 030	€	6 410
Actions émises en circulation		1 140		1 013		589
VNI par action	€	9,32	€	10,89	€	10,88
Investisseurs en USD (couverte) :						
Capitalisation	$	9	$	10		S/O
Actions émises en circulation		1		1		S/O
VNI par action	$	8,94	$	10,22		S/O
BM Détail en AUD (couverte) :						
Distribution II	AUD	12		S/O		S/O
Actions émises en circulation		1		S/O		S/O
VNI par action	AUD	9,19		S/O		S/O
BM Détail en USD (couverte) :						
Distribution II	$	9		S/O		S/O
Actions émises en circulation		1		S/O		S/O
VNI par action	$	9,25		S/O		S/O
Catégorie E :						
Capitalisation	€	1 913 579	€	2 955 626	€	1 985 483
Actions émises en circulation		171 934		225 981		150 907
VNI par action	€	11,13	€	13,08	€	13,16
Distribution	€	4 679	€	5 627		1 063
Actions émises en circulation		506		517		97
VNI par action	€	9,25	€	10,87		10,94
Catégorie E en USD (couverte) :						
Capitalisation	$	192 230	$	275 658	$	129 718
Actions émises en circulation		16 657		20 756		9 795
VNI par action	$	11,54	$	13,28	$	13,24
Distribution	$	32	$	10		S/O
Actions émises en circulation		4		1		S/O
VNI par action	$	8,84	$	10,18		S/O
Distribution II	$	9	$	10		S/O
Actions émises en circulation		1		1		S/O
VNI par action	$	8,27	$	9,80		S/O
H Institutions en USD (couverte) :						
Capitalisation	$	2 298	$	8 850	$	70 265
Actions émises en circulation		240		810		6 498
VNI par action	$	9,58	$	10,93	$	10,81
M Détail en AUD (couverte) :						
Distribution II	AUD	321	AUD	563		S/O
Actions émises en circulation		39		57		S/O
VNI par action	AUD	8,17	AUD	9,87		S/O
M Détail en SGD (couverte) :						
Distribution II	SGD	12 812	SGD	16 539	SGD	346
Actions émises en circulation		1 538		1 673		34
VNI par action	SGD	8,33	SGD	9,89	SGD	10,16
M Détail en USD (couverte) :						
Distribution II	$	65 622	$	120 842	$	84 157
Actions émises en circulation		7 183		11 077		7 457
VNI par action	$	9,14	$	10,91	$	11,29

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund (suite)						
Catégorie T :						
Capitalisation	€	83 511	€	118 172	€	56 375
Actions émises en circulation		8 130		9 750		4 605
VNI par action	€	10,27	€	12,12	€	12,24
Catégorie T en USD (couverte) :						
Capitalisation	$	3 396	$	618		S/O
Actions émises en circulation		399		63		S/O
VNI par action	$	8,51	$	9,83		S/O
Catégorie Z :						
Capitalisation	€	151 534	€	192 397	€	76 639
Actions émises en circulation		14 087		15 504		6 254
VNI par action	€	10,76	€	12,41	€	12,25
Fonds Emerging Local Bond Fund						
Actif net	$	1 919 668	$	2 151 129	$	2 849 284
Institutions :						
Capitalisation	$	1 295 760	$	1 416 960	$	1 942 594
Actions émises en circulation		102 499		104 910		132 226
VNI par action	$	12,64	$	13,51	$	14,69
Distribution	$	67 645	$	77 715	$	94 610
Actions émises en circulation		11 061		11 365		12 100
VNI par action	$	6,12	$	6,84	$	7,82
Institutions en CHF (non couverte) :						
Capitalisation		S/O	CHF	397	CHF	491
Actions émises en circulation		S/O		44		51
VNI par action		S/O	CHF	9,06	CHF	9,56
Institutions en EUR (non couverte) :						
Capitalisation	€	172 199	€	250 076	€	165 027
Actions émises en circulation		13 181		19 088		12 458
VNI par action	€	13,06	€	13,10	€	13,25
Distribution	€	133 001	€	123 817	€	288 525
Actions émises en circulation		20 143		17 869		39 179
VNI par action	€	6,60	€	6,93	€	7,36
Institutions en GBP (non couverte) :						
Capitalisation	£	3 791	£	2 364	£	2 910
Actions émises en circulation		183		120		137
VNI par action	£	20,76	£	19,70	£	21,23
Investisseurs :						
Capitalisation	$	19 075	$	38 617	$	24 099
Actions émises en circulation		2 001		3 779		2 159
VNI par action	$	9,53	$	10,22	$	11,16
Investisseurs en EUR (non couverte) :						
Capitalisation	€	698	€	3 081	€	3 074
Actions émises en circulation		75		330		325
VNI par action	€	9,28	€	9,33	€	9,47
Catégorie E :						
Capitalisation	$	35 736	$	39 398	$	53 089
Actions émises en circulation		3 249		3 319		4 070
VNI par action	$	11,00	$	11,87	$	13,04
Distribution	$	12 985	$	15 964	$	22 053
Actions émises en circulation		2 266		2 492		3 012
VNI par action	$	5,73	$	6,41	$	7,32
Catégorie E en EUR (non couverte) :						
Capitalisation	€	65 014	€	77 057	€	102 405
Actions émises en circulation		4 579		5 359		6 974
VNI par action	€	14,20	€	14,38	€	14,68
Distribution	€	1 510	€	1 782	€	2 018
Actions émises en circulation		168		189		202
VNI par action	€	8,97	€	9,41	€	10,00
H Institutions :						
Capitalisation	$	48 210	$	10		S/O
Actions émises en circulation		5 416		1		S/O
VNI par action	$	8,90	$	9,52		S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds Emerging Local Bond Fund (suite)		
Catégorie Z :			
Distribution	$ 38 228	$ 40 482	$ 21 833
Actions émises en circulation	5 218	4 941	2 331
VNI par action	$ 7,33	$ 8,19	$ 9,37
	Fonds Emerging Local Bond ESG Fund		
Actif net	$ 6 609	S/O	S/O
Institutions :			
Capitalisation	$ 5 169	S/O	S/O
Actions émises en circulation	489	S/O	S/O
VNI par action	$ 10,57	S/O	S/O
Distribution	$ 11	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	$ 10,34	S/O	S/O
Institutions en EUR (non couverte) :			
Capitalisation	€ 9	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	€ 10,02	S/O	S/O
Distribution	€ 9	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	€ 9,81	S/O	S/O
Investisseurs :			
Capitalisation	$ 11	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	$ 10,56	S/O	S/O
Distribution	$ 11	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	$ 10,34	S/O	S/O
Investisseurs en EUR (non couverte) :			
Capitalisation	€ 9	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	€ 10,01	S/O	S/O
Distribution	€ 9	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	€ 9,81	S/O	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 11	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	$ 10,53	S/O	S/O
Distribution	$ 11	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	$ 10,34	S/O	S/O
Catégorie E en EUR (non couverte) :			
Capitalisation	€ 9	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	€ 9,98	S/O	S/O
Distribution	€ 9	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	€ 9,80	S/O	S/O
Catégorie Z :			
Capitalisation	$ 1 329	S/O	S/O
Actions émises en circulation	123	S/O	S/O
VNI par action	$ 10,77	S/O	S/O
	Fonds Emerging Markets Bond Fund		
Actif net	$ 3 305 979	$ 4 714 744	$ 5 263 015
Institutions :			
Capitalisation	$ 1 097 175	$ 1 578 727	$ 1 855 635
Actions émises en circulation	24 303	28 997	33 297
VNI par action	$ 45,15	$ 54,45	$ 55,73
Distribution	$ 56 849	$ 92 620	$ 79 496
Actions émises en circulation	3 860	4 961	3 984
VNI par action	$ 14,73	$ 18,67	$ 19,95

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)		
Institutions en CHF (couverte) :			
Distribution	CHF 77 505	CHF 97 681	CHF 101 703
Actions émises en circulation	5 390	5 215	5 020
VNI par action	CHF 14,38	CHF 18,73	CHF 20,26
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 694 951	€ 695 028	€ 727 017
Actions émises en circulation	19 643	15 897	16 095
VNI par action	€ 35,38	€ 43,72	€ 45,17
Distribution	€ 401 157	€ 847 991	€ 768 610
Actions émises en circulation	58 854	95 747	80 394
VNI par action	€ 6,82	€ 8,86	€ 9,56
Institutions en EUR (non couverte) :			
Capitalisation	€ 135 251	€ 164 246	€ 156 149
Actions émises en circulation	12 028	12 905	12 896
VNI par action	€ 11,24	€ 12,73	€ 12,11
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 23 424	£ 26 418	£ 13 006
Actions émises en circulation	997	922	442
VNI par action	£ 23,50	£ 28,67	£ 29,43
Distribution	£ 28 487	£ 41 458	£ 67 185
Actions émises en circulation	8 167	9 258	13 988
VNI par action	£ 3,49	£ 4,48	£ 4,80
Institutions en PLN (couverte) :			
Distribution	S/O	PLN 95 531	S/O
Actions émises en circulation	S/O	9 927	S/O
VNI par action	S/O	PLN 9,62	S/O
Institutions en SGD (couverte) :			
Capitalisation	SGD 31 394	SGD 32 296	SGD 16 392
Actions émises en circulation	3 178	2 703	1 340
VNI par action	SGD 9,88	SGD 11,95	SGD 12,23
Investisseurs :			
Capitalisation	$ 3 988	$ 7 210	$ 7 681
Actions émises en circulation	95	142	147
VNI par action	$ 42,01	$ 50,84	$ 52,22
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 3 248	€ 4 103	€ 4 086
Actions émises en circulation	398	406	390
VNI par action	€ 8,16	€ 10,11	€ 10,48
Administrations :			
Capitalisation	$ 22 981	$ 34 503	$ 34 306
Actions émises en circulation	560	693	670
VNI par action	$ 41,06	$ 49,77	$ 51,20
BM Détail :			
Distribution II	$ 9	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	$ 9,11	S/O	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 114 186	$ 165 453	$ 185 616
Actions émises en circulation	2 933	3 492	3 793
VNI par action	$ 38,93	$ 47,38	$ 48,93
Distribution	$ 61 547	$ 109 051	$ 151 156
Actions émises en circulation	6 932	9 691	12 574
VNI par action	$ 8,88	$ 11,25	$ 12,02
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 125 229	€ 187 716	€ 195 834
Actions émises en circulation	4 112	4 943	4 947
VNI par action	€ 30,46	€ 37,98	€ 39,59
Catégorie E en SGD (couverte) :			
Capitalisation	SGD 10 020	SGD 11 604	SGD 12 729
Actions émises en circulation	181	172	183
VNI par action	SGD 55,23	SGD 67,40	SGD 69,62

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds Emerging Markets Bond Fund (suite)			
H Institutions :			
Capitalisation	$ 302 479	$ 284 247	$ 401 692
Actions émises en circulation	6 875	5 348	7 371
VNI par action	$ 44,00	$ 53,15	$ 54,50
Distribution	$ 217	$ 275	$ 10
Actions émises en circulation	29	29	1
VNI par action	$ 7,55	$ 9,57	$ 10,22
M Détail :			
Distribution	$ 8 675	$ 12 295	$ 14 913
Actions émises en circulation	1 085	1 214	1 379
VNI par action	$ 8,00	$ 10,13	$ 10,82
Distribution II	$ 3 190	$ 3 720	$ 6 538
Actions émises en circulation	473	428	693
VNI par action	$ 6,75	$ 8,68	$ 9,44
M Détail en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 1 510	AUD 7 264	AUD 9 306
Actions émises en circulation	209	784	936
VNI par action	AUD 7,22	AUD 9,27	AUD 9,94
Catégorie Z :			
Distribution	$ 5 279	$ 6 317	$ 6 442
Actions émises en circulation	540	509	486
VNI par action	$ 9,78	$ 12,41	$ 13,26
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund			
Actif net	$ 2 492 475	$ 2 635 769	$ 1 441 457
Institutions :			
Capitalisation	$ 640 128	$ 650 604	$ 482 367
Actions émises en circulation	45 303	37 005	26 644
VNI par action	$ 14,13	$ 17,58	$ 18,10
Distribution	$ 306 128	$ 305 572	$ 18 961
Actions émises en circulation	40 679	31 166	1 806
VNI par action	$ 7,53	$ 9,80	$ 10,50
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 53 384	CHF 50 716	S/O
Actions émises en circulation	6 825	5 067	S/O
VNI par action	CHF 7,82	CHF 10,01	S/O
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 1 011 465	€ 999 329	€ 566 203
Actions émises en circulation	104 063	80 567	43 901
VNI par action	€ 9,72	€ 12,40	€ 12,90
Distribution	€ 132 184	€ 192 797	€ 111 597
Actions émises en circulation	19 921	21 737	11 631
VNI par action	€ 6,64	€ 8,87	€ 9,59
Institutions en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 162 630	£ 80 974	£ 3 499
Actions émises en circulation	22 478	8 479	341
VNI par action	£ 7,24	£ 9,55	£ 10,26
Institutions en GBP (non couverte) :			
Distribution	£ 3 960	£ 3 657	£ 7
Actions émises en circulation	499	398	1
VNI par action	£ 7,94	£ 9,19	£ 9,76
Investisseurs en NOK (couverte) :			
Capitalisation	NOK 5 222	NOK 6 610	NOK 7 902
Actions émises en circulation	50	50	58
VNI par action	NOK 103,95	NOK 131,59	NOK 136,26
Investisseurs en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 27 736	SEK 10 725	SEK 12 623
Actions émises en circulation	292	89	100
VNI par action	SEK 95,02	SEK 121,06	SEK 125,92
Administrations :			
Capitalisation	$ 314	$ 632	$ 1 121
Actions émises en circulation	37	59	102
VNI par action	$ 8,53	$ 10,67	$ 11,04

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (suite)			
Distribution	$ 718	$ 992	$ 293
Actions émises en circulation	95	101	28
VNI par action	$ 7,53	$ 9,81	$ 10,50
Administrations en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 105	SEK 85	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	SEK 77,61	SEK 99,05	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 924	$ 1 531	S/O
Actions émises en circulation	120	158	S/O
VNI par action	$ 7,71	$ 9,68	S/O
Distribution	$ 676	$ 868	S/O
Actions émises en circulation	94	92	S/O
VNI par action	$ 7,23	$ 9,41	S/O
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 57 844	€ 129 837	€ 83 479
Actions émises en circulation	6 822	11 895	7 294
VNI par action	€ 8,48	€ 10,92	€ 11,45
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund			
Actif net	$ 168 986	$ 212 894	$ 261 236
Institutions :			
Capitalisation	$ 8 279	$ 9 507	$ 20 306
Actions émises en circulation	535	532	1 128
VNI par action	$ 15,48	$ 17,88	$ 18,01
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 102 077	€ 113 058	€ 126 871
Actions émises en circulation	7 881	7 392	8 166
VNI par action	€ 12,95	€ 15,29	€ 15,54
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 15 703	$ 22 756	$ 22 272
Actions émises en circulation	1 342	1 668	1 607
VNI par action	$ 11,70	$ 13,64	$ 13,86
Catégorie E en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 10 121	CHF 14 255	CHF 16 710
Actions émises en circulation	1 048	1 235	1 410
VNI par action	CHF 9,66	CHF 11,54	CHF 11,85
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 23 540	€ 32 022	€ 36 387
Actions émises en circulation	2 072	2 365	2 622
VNI par action	€ 11,36	€ 13,54	€ 13,88
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund			
Actif net	$ 205 131	$ 290 475	$ 220 309
Institutions :			
Capitalisation	$ 25 166	$ 48 615	$ 13 910
Actions émises en circulation	2 449	4 383	1 214
VNI par action	$ 10,28	$ 11,09	$ 11,47
Institutions en EUR (partiellement couverte) :			
Capitalisation	€ 72 560	€ 212 680	€ 168 688
Actions émises en circulation	7 427	19 839	15 309
VNI par action	€ 9,77	€ 10,72	€ 11,02
Institutions en GBP (partiellement couverte) :			
Distribution	£ 760	S/O	S/O
Actions émises en circulation	81	S/O	S/O
VNI par action	£ 9,37	S/O	S/O
Catégorie E en EUR (partiellement couverte) :			
Capitalisation	€ 9	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	€ 9,38	S/O	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund (suite)		
Catégorie Z :			
Capitalisation	$ 101 602	S/O	S/O
Actions émises en circulation	10 102	S/O	S/O
VNI par action	$ 10,06	S/O	S/O
	Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		
Actif net	$ 20 937	$ 29 760	$ 32 571
Institutions :			
Capitalisation	S/O	$ 114	$ 139
Actions émises en circulation	S/O	8	10
VNI par action	S/O	$ 14,02	$ 14,44
Institutions en EUR (non couverte) :			
Capitalisation	€ 6 154	€ 10 250	€ 7 119
Actions émises en circulation	437	743	538
VNI par action	€ 14,08	€ 13,80	€ 13,21
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 4 388	$ 5 195	$ 6 144
Actions émises en circulation	371	417	474
VNI par action	$ 11,84	$ 12,47	$ 12,97
Catégorie E en EUR (non couverte) :			
Capitalisation	€ 9 351	€ 11 252	€ 14 366
Actions émises en circulation	700	852	1 126
VNI par action	€ 13,36	€ 13,20	€ 12,76
	Fonds PIMCO ESG Income Fund		
Actif net	$ 237 961	$ 125 087	S/O
Institutions :			
Capitalisation	$ 23 414	$ 5 465	S/O
Actions émises en circulation	2 486	541	S/O
VNI par action	$ 9,42	$ 10,10	S/O
Distribution	$ 3 575	$ 3 756	S/O
Actions émises en circulation	393	375	S/O
VNI par action	$ 9,10	$ 10,02	S/O
Institutions en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 57 036	AUD 14	S/O
Actions émises en circulation	6 338	1	S/O
VNI par action	AUD 9,00	AUD 10,00	S/O
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 7 316	CHF 692	S/O
Actions émises en circulation	803	69	S/O
VNI par action	CHF 9,11	CHF 10,02	S/O
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 105 509	€ 72 025	S/O
Actions émises en circulation	11 509	7 175	S/O
VNI par action	€ 9,17	€ 10,04	S/O
Distribution	€ 1 925	€ 223	S/O
Actions émises en circulation	217	22	S/O
VNI par action	€ 8,85	€ 9,95	S/O
Institutions en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 405	£ 482	S/O
Actions émises en circulation	44	48	S/O
VNI par action	£ 9,00	£ 9,98	S/O
Institutions en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 122 486	SEK 77 208	S/O
Actions émises en circulation	1 335	772	S/O
VNI par action	SEK 91,73	SEK 99,96	S/O
Institutions en SGD (couverte) :			
Distribution	SGD 367	SGD 366	S/O
Actions émises en circulation	40	36	S/O
VNI par action	SGD 9,09	SGD 10,02	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds PIMCO ESG Income Fund (suite)		
Administrations en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 79 369	S/O	S/O
Actions émises en circulation	816	S/O	S/O
VNI par action	SEK 97,22	S/O	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 1 433	$ 285	S/O
Actions émises en circulation	155	28	S/O
VNI par action	$ 9,28	$ 10,04	S/O
Distribution	$ 387	$ 20	S/O
Actions émises en circulation	43	2	S/O
VNI par action	$ 9,10	$ 10,01	S/O
Catégorie E en CHF (couverte) :			
Distribution	CHF 9	CHF 9	S/O
Actions émises en circulation	1	1	S/O
VNI par action	CHF 8,81	CHF 9,94	S/O
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 4 811	€ 1 113	S/O
Actions émises en circulation	535	112	S/O
VNI par action	€ 8,99	€ 9,94	S/O
Distribution	€ 1 016	€ 256	S/O
Actions émises en circulation	115	26	S/O
VNI par action	€ 8,86	€ 9,96	S/O
Catégorie R en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 31 770	AUD 29 726	S/O
Actions émises en circulation	3 530	2 973	S/O
VNI par action	AUD 9,00	AUD 10,00	S/O
	Fonds Euro Bond Fund		
Actif net	€ 1 913 275	€ 2 574 129	€ 3 243 455
Institutions :			
Capitalisation	€ 1 386 127	€ 1 926 406	€ 2 235 581
Actions émises en circulation	64 252	73 731	82 583
VNI par action	€ 21,57	€ 26,13	€ 27,07
Distribution	€ 68 589	€ 92 872	€ 378 659
Actions émises en circulation	4 956	5 474	21 418
VNI par action	€ 13,84	€ 16,97	€ 17,68
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 313 292	CHF 351 467	CHF 307 434
Actions émises en circulation	10 631	9 789	8 243
VNI par action	CHF 29,47	CHF 35,91	CHF 37,30
Investisseurs :			
Capitalisation	€ 16 885	€ 23 320	€ 38 680
Actions émises en circulation	841	956	1 524
VNI par action	€ 20,08	€ 24,41	€ 25,38
Distribution	S/O	€ 236	€ 679
Actions émises en circulation	S/O	15	40
VNI par action	S/O	€ 16,28	€ 16,97
Administrations :			
Capitalisation	S/O	€ 2 579	€ 5 248
Actions émises en circulation	S/O	110	215
VNI par action	S/O	€ 23,48	€ 24,45
Catégorie E :			
Capitalisation	€ 101 050	€ 151 006	€ 241 554
Actions émises en circulation	5 451	6 666	10 200
VNI par action	€ 18,54	€ 22,65	€ 23,68
Distribution	€ 23 340	€ 38 508	€ 58 802
Actions émises en circulation	2 337	3 146	4 596
VNI par action	€ 9,99	€ 12,24	€ 12,79
	Fonds Euro Credit Fund		
Actif net	€ 610 008	€ 1 017 163	€ 1 150 058
Institutions :			
Capitalisation	€ 348 784	€ 743 335	€ 854 429
Actions émises en circulation	24 516	43 513	49 448
VNI par action	€ 14,23	€ 17,08	€ 17,28

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds Euro Credit Fund (suite)			
Distribution II	€ 16 940	€ 80 562	€ 110 981
Actions émises en circulation	1 879	7 303	9 831
VNI par action	€ 9,02	€ 11,03	€ 11,29
Catégorie E :			
Capitalisation	€ 11 194	€ 18 325	€ 24 907
Actions émises en circulation	1 001	1 353	1 802
VNI par action	€ 11,18	€ 13,54	€ 13,82
H Institutions :			
Capitalisation	€ 232 926	€ 173 091	€ 156 377
Actions émises en circulation	27 156	16 823	15 036
VNI par action	€ 8,58	€ 10,29	€ 10,40
Distribution II	€ 164	€ 1 850	€ 3 364
Actions émises en circulation	20	186	331
VNI par action	€ 8,14	€ 9,93	€ 10,16
Fonds Euro Income Bond Fund			
Actif net	€ 1 352 980	€ 2 482 304	€ 3 182 867
Institutions :			
Capitalisation	€ 332 727	€ 895 043	€ 882 179
Actions émises en circulation	23 944	56 691	55 950
VNI par action	€ 13,90	€ 15,79	€ 15,77
Distribution	€ 79 523	€ 128 548	€ 215 485
Actions émises en circulation	8 533	11 833	19 471
VNI par action	€ 9,32	€ 10,86	€ 11,07
Investisseurs :			
Capitalisation	€ 10 138	€ 14 129	€ 6 268
Actions émises en circulation	1 136	1 388	615
VNI par action	€ 8,93	€ 10,18	€ 10,20
Distribution	€ 8 520	€ 10 907	€ 19 825
Actions émises en circulation	939	1 027	1 826
VNI par action	€ 9,08	€ 10,62	€ 10,86
Catégorie E :			
Capitalisation	€ 540 713	€ 856 874	€ 1 263 972
Actions émises en circulation	43 285	59 839	87 596
VNI par action	€ 12,49	€ 14,32	€ 14,43
Distribution	€ 347 514	€ 527 452	€ 731 652
Actions émises en circulation	41 763	53 871	72 655
VNI par action	€ 8,32	€ 9,79	€ 10,07
Distribution Q	S/O	€ 3 868	€ 4 485
Actions émises en circulation	S/O	406	455
VNI par action	S/O	€ 9,53	€ 9,86
Catégorie T :			
Capitalisation	€ 24 746	€ 32 571	€ 41 015
Actions émises en circulation	2 573	2 943	3 663
VNI par action	€ 9,62	€ 11,07	€ 11,20
Distribution	€ 9 099	€ 12 914	€ 17 986
Actions émises en circulation	1 234	1 482	1 998
VNI par action	€ 7,38	€ 8,72	€ 9,00
Fonds Euro Long Average Duration Fund			
Actif net	€ 110 048	€ 160 601	€ 182 461
Institutions :			
Capitalisation	€ 110 048	€ 160 601	€ 182 461
Actions émises en circulation	5 786	5 426	5 656
VNI par action	€ 19,02	€ 29,60	€ 32,26
Fonds Euro Short-Term Fund			
Actif net	€ 353 095	€ 629 859	€ 807 538
Institutions :			
Capitalisation	€ 339 031	€ 616 693	€ 789 499
Actions émises en circulation	28 689	51 558	65 792
VNI par action	€ 11,82	€ 11,96	€ 12,00

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds Euro Short-Term Fund (suite)			
Catégorie E :			
Capitalisation	€ 14 064	€ 13 166	€ 18 039
Actions émises en circulation	1 350	1 239	1 679
VNI par action	€ 10,42	€ 10,63	€ 10,74
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund			
Actif net	€ 174 162	€ 170 489	€ 162 061
Institutions :			
Capitalisation	€ 32 875	€ 12 500	€ 9 610
Actions émises en circulation	3 379	1 159	918
VNI par action	€ 9,73	€ 10,79	€ 10,46
Catégorie E :			
Capitalisation	€ 10	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	€ 10,00	S/O	S/O
Catégorie Z :			
Capitalisation	€ 141 277	€ 157 989	€ 152 451
Actions émises en circulation	14 301	14 501	14 501
VNI par action	€ 9,88	€ 10,90	€ 10,51
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund			
Actif net	€ 211 172	€ 395 491	€ 350 749
Institutions :			
Capitalisation	€ 127 942	€ 254 925	€ 259 542
Actions émises en circulation	11 637	22 466	22 487
VNI par action	€ 10,99	€ 11,35	€ 11,54
Catégorie E :			
Capitalisation	€ 7 775	€ 4 368	€ 6 217
Actions émises en circulation	826	447	623
VNI par action	€ 9,42	€ 9,77	€ 9,99
H Institutions :			
Capitalisation	€ 75 455	€ 136 198	€ 84 990
Actions émises en circulation	7 907	13 806	8 456
VNI par action	€ 9,54	€ 9,87	€ 10,05
Fonds Global Advantage Fund			
Actif net	$ 410 459	$ 521 067	$ 524 284
Institutions :			
Capitalisation	$ 7 716	$ 24 968	$ 32 718
Actions émises en circulation	582	1 630	2 070
VNI par action	$ 13,28	$ 15,32	$ 15,81
Institutions en CHF (partiellement couverte) :			
Distribution	CHF 111 046	CHF 132 681	CHF 136 133
Actions émises en circulation	12 487	12 823	12 809
VNI par action	CHF 8,89	CHF 10,35	CHF 10,63
Institutions en EUR (partiellement couverte) :			
Capitalisation	€ 203 446	€ 237 602	€ 215 680
Actions émises en circulation	15 828	16 656	15 249
VNI par action	€ 12,85	€ 14,26	€ 14,14
Institutions en GBP (partiellement couverte) :			
Capitalisation	S/O	£ 182	£ 162
Actions émises en circulation	S/O	14	12
VNI par action	S/O	£ 13,42	£ 13,45
Institutions en NOK (partiellement couverte) :			
Capitalisation	NOK 577 381	NOK 625 501	NOK 526 754
Actions émises en circulation	4 099	4 093	3 462
VNI par action	NOK 140,84	NOK 152,81	NOK 152,16
Catégorie E en EUR (partiellement couverte) :			
Capitalisation	€ 6 540	€ 8 002	€ 9 744
Actions émises en circulation	576	629	764
VNI par action	€ 11,36	€ 12,73	€ 12,75

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds Global Bond Fund		
Actif net	$ 11 420 112	$ 14 038 846	$ 16 302 309
Institutions :			
Capitalisation	$ 3 410 090	$ 3 999 850	$ 4 781 849
Actions émises en circulation	107 593	111 904	131 859
VNI par action	$ 31,69	$ 35,74	$ 36,26
Distribution	$ 172 513	$ 203 191	$ 241 431
Actions émises en circulation	9 898	10 136	11 685
VNI par action	$ 17,43	$ 20,05	$ 20,66
Institutions (exposition au risque de change) :			
Capitalisation	$ 326 665	$ 328 710	$ 413 925
Actions émises en circulation	11 261	9 512	11 412
VNI par action	$ 29,01	$ 34,56	$ 36,27
Distribution	$ 19 875	$ 26 341	$ 44 078
Actions émises en circulation	1 080	1 178	1 848
VNI par action	$ 18,41	$ 22,37	$ 23,86
Institutions en CAD (couverte) :			
Capitalisation	CAD 54 563	CAD 72 089	CAD 83 688
Actions émises en circulation	5 395	6 309	7 213
VNI par action	CAD 10,11	CAD 11,43	CAD 11,60
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 440 925	CHF 552 547	CHF 464 413
Actions émises en circulation	14 706	15 928	13 054
VNI par action	CHF 29,98	CHF 34,69	CHF 35,58
Distribution	CHF 175 781	CHF 218 701	CHF 213 078
Actions émises en circulation	10 095	10 645	9 953
VNI par action	CHF 17,41	CHF 20,54	CHF 21,41
Institutions en EUR (exposition au risque de change) :			
Capitalisation	€ 190 480	€ 139 337	€ 163 042
Actions émises en circulation	14 810	9 692	11 624
VNI par action	€ 12,86	€ 14,38	€ 14,03
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 1 974 600	€ 2 453 258	€ 2 491 097
Actions émises en circulation	78 287	84 453	83 802
VNI par action	€ 25,22	€ 29,05	€ 29,73
Distribution	€ 512 652	€ 628 774	€ 766 678
Actions émises en circulation	32 355	33 781	39 612
VNI par action	€ 15,84	€ 18,61	€ 19,35
Institutions en GBP (exposition au risque de change) :			
Capitalisation	£ 3 343	£ 3 600	£ 4 429
Actions émises en circulation	313	319	377
VNI par action	£ 10,68	£ 11,30	£ 11,75
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 162 896	£ 198 000	£ 160 075
Actions émises en circulation	7 879	8 429	6 703
VNI par action	£ 20,68	£ 23,49	£ 23,88
Distribution	£ 132 242	£ 191 729	£ 254 507
Actions émises en circulation	10 904	13 574	17 444
VNI par action	£ 12,13	£ 14,13	£ 14,59

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds Global Bond Fund (suite)		
Institutions en ILS (couverte) :			
Capitalisation	S/O	ILS 304	ILS 331
Actions émises en circulation	S/O	18	19
VNI par action	S/O	ILS 16,75	ILS 17,09
Institutions en NOK (couverte) :			
Capitalisation	NOK 2 918 045	NOK 4 130 842	NOK 3 542 383
Actions émises en circulation	14 215	17 688	14 946
VNI par action	NOK 205,28	NOK 233,55	NOK 237,01
Institutions en NZD (couverte) :			
Distribution	NZD 167 929	NZD 309 397	NZD 250 817
Actions émises en circulation	4 162	6 643	5 230
VNI par action	NZD 40,35	NZD 46,57	NZD 47,96
Institutions en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 1 120 588	SEK 1 219 998	SEK 1 176 107
Actions émises en circulation	5 712	5 426	5 129
VNI par action	SEK 196,17	SEK 224,86	SEK 229,29
Institutions en SGD (couverte) :			
Capitalisation	SGD 217 237	SGD 174 944	SGD 176 007
Actions émises en circulation	12 665	9 030	8 960
VNI par action	SGD 17,15	SGD 19,37	SGD 19,64
Investisseurs :			
Capitalisation	$ 94 643	$ 135 136	$ 195 058
Actions émises en circulation	3 244	4 092	5 801
VNI par action	$ 29,18	$ 33,02	$ 33,62
Distribution	$ 28 517	$ 7 773	$ 9 885
Actions émises en circulation	1 948	462	570
VNI par action	$ 14,64	$ 16,84	$ 17,35
Investisseurs (exposition au risque de change) :			
Capitalisation	S/O	$ 2 315	$ 5 415
Actions émises en circulation	S/O	71	158
VNI par action	S/O	$ 32,58	$ 34,32
Investisseurs en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 145 814	CHF 188 770	CHF 283 165
Actions émises en circulation	12 641	14 095	20 545
VNI par action	CHF 11,53	CHF 13,39	CHF 13,78
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 75 495	€ 92 541	€ 83 112
Actions émises en circulation	3 189	3 382	2 958
VNI par action	€ 23,68	€ 27,36	€ 28,10
Investisseurs en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 5 437	£ 5 846	£ 6 089
Actions émises en circulation	280	264	269
VNI par action	£ 19,45	£ 22,17	£ 22,62
Investisseurs en NOK (couverte) :			
Capitalisation	NOK 23 662	NOK 28 765	NOK 32 011
Actions émises en circulation	122	130	142
VNI par action	NOK 193,71	NOK 221,16	NOK 225,22
Administrations :			
Capitalisation	$ 9 565	$ 15 922	$ 23 302
Actions émises en circulation	337	495	710
VNI par action	$ 28,38	$ 32,16	$ 32,80

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
	Fonds Global Bond Fund (suite)					
Administrations en SEK (couverte) :						
Capitalisation	SEK	114 069	SEK	1 941		S/O
Actions émises en circulation		1 325		20		S/O
VNI par action	SEK	86,08	SEK	99,17		S/O
Catégorie E :						
Capitalisation	$	326 703	$	463 700	$	550 753
Actions émises en circulation		12 006		14 974		17 372
VNI par action	$	27,21	$	30,97	$	31,70
Distribution	$	101 393	$	117 421	$	201 589
Actions émises en circulation		8 054		8 111		13 511
VNI par action	$	12,59	$	14,48	$	14,92
Catégorie E (exposition au risque de change) :						
Capitalisation	$	34 705	$	61 145	$	84 089
Actions émises en circulation		2 994		4 389		5 699
VNI par action	$	11,59	$	13,93	$	14,76
Distribution	$	13 040	$	16 440	$	19 720
Actions émises en circulation		1 324		1 374		1 545
VNI par action	$	9,85	$	11,97	$	12,76
Catégorie E en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	1 921	CHF	2 358	CHF	2 635
Actions émises en circulation		215		226		244
VNI par action	CHF	8,92	CHF	10,41	CHF	10,78
Catégorie E en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	685 427	€	959 543	€	1 168 524
Actions émises en circulation		31 641		38 117		44 954
VNI par action	€	21,66	€	25,17	€	25,99
Distribution	€	31 423	€	41 846	€	61 268
Actions émises en circulation		3 613		4 097		5 769
VNI par action	€	8,70	€	10,22	€	10,62
Catégorie E en NOK (couverte) :						
Capitalisation		S/O	NOK	85		S/O
Actions émises en circulation		S/O		1		S/O
VNI par action		S/O	NOK	99,69		S/O
G Détail en EUR (couverte) :						
Distribution	€	66 161	€	123 034	€	140 905
Actions émises en circulation		7 543		11 955		13 167
VNI par action	€	8,77	€	10,29	€	10,70
H Institutions :						
Capitalisation	$	752 379	$	835 136	$	954 525
Actions émises en circulation		24 551		24 124		27 130
VNI par action	$	30,65	$	34,62	$	35,18
Distribution	$	2 035	$	2 643	$	3 905
Actions émises en circulation		231		261		375
VNI par action	$	8,79	$	10,11	$	10,42
H Institutions (exposition au risque de change) :						
Capitalisation	$	309 569	$	756		S/O
Actions émises en circulation		37 885		78		S/O
VNI par action	$	8,17	$	9,75		S/O
M Détail :						
Distribution II	$	1 358	$	1 742	$	2 809
Actions émises en circulation		153		168		260
VNI par action	$	8,89	$	10,34	$	10,80
M Détail en HKD (non couverte) :						
Distribution II	HKD	5 118	HKD	8 307	HKD	11 626
Actions émises en circulation		575		802		1 081
VNI par action	HKD	8,91	HKD	10,35	HKD	10,76
M Détail en SEK (couverte) :						
Capitalisation		S/O	SEK	90		S/O
Actions émises en circulation		S/O		1		S/O
VNI par action		S/O	SEK	99,56		S/O

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
	Fonds Global Bond Fund (suite)					
Catégorie R en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	5 591	€	6 442	€	5 196
Actions émises en circulation		530		528		415
VNI par action	€	10,56	€	12,19	€	12,51
Catégorie R en SEK (couverte) :						
Capitalisation		S/O		S/O	SEK	100
Actions émises en circulation		S/O		S/O		1
VNI par action		S/O		S/O	SEK	111,31
Catégorie T :						
Capitalisation	$	15 814	$	26 245	$	42 315
Actions émises en circulation		1 487		2 163		3 396
VNI par action	$	10,63	$	12,14	$	12,46
Distribution	$	3 040	$	4 183	$	5 274
Actions émises en circulation		303		362		443
VNI par action	$	10,04	$	11,54	$	11,89
Catégorie T en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	14 560	€	19 104	€	25 635
Actions émises en circulation		1 567		1 764		2 285
VNI par action	€	9,29	€	10,83	€	11,22
Catégorie W :						
Capitalisation	$	24 415	$	29 951	$	21 207
Actions émises en circulation		2 721		2 962		2 070
VNI par action	$	8,97	$	10,11	$	10,25
Distribution	$	9 498	$	9 066	$	13 683
Actions émises en circulation		1 106		919		1 345
VNI par action	$	8,59	$	9,87	$	10,17
Catégorie W (exposition au risque de change) :						
Capitalisation		S/O	$	10	$	10
Actions émises en circulation		S/O		1		1
VNI par action		S/O	$	10,00	$	10,48
Distribution		S/O	$	10	$	10
Actions émises en circulation		S/O		1		1
VNI par action		S/O	$	9,77	$	10,41
Catégorie W en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	24 828	CHF	33 361	CHF	35 760
Actions émises en circulation		2 884		3 352		3 508
VNI par action	CHF	8,61	CHF	9,95	CHF	10,20
Distribution	CHF	705	CHF	740	CHF	9
Actions émises en circulation		86		76		1
VNI par action	CHF	8,24	CHF	9,72	CHF	10,12
Catégorie W en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	9 594	€	14 976	€	14 731
Actions émises en circulation		1 106		1 500		1 444
VNI par action	€	8,68	€	9,98	€	10,20
Distribution	€	2 352	€	2 251	€	1 740
Actions émises en circulation		283		231		172
VNI par action	€	8,30	€	9,75	€	10,14
Catégorie W en GBP (couverte) :						
Capitalisation	£	2 383	£	1 265	£	139
Actions émises en circulation		268		126		14
VNI par action	£	8,88	£	10,08	£	10,23
Distribution	£	5 877	£	9 060	£	8 773
Actions émises en circulation		692		921		863
VNI par action	£	8,49	£	9,84	£	10,16
Catégorie W en NOK (couverte) :						
Capitalisation	NOK	4 083	NOK	3 799		S/O
Actions émises en circulation		46		38		S/O
VNI par action	NOK	88,35	NOK	100,41		S/O
Catégorie W en SEK (couverte) :						
Capitalisation		S/O	SEK	89	SEK	91
Actions émises en circulation		S/O		1		1
VNI par action		S/O	SEK	100,33	SEK	102,20

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds Global Bond ESG Fund		
Actif net	$ 3 106 190	$ 2 302 966	$ 1 509 594
Institutions :			
Capitalisation	$ 366 227	$ 300 944	$ 153 820
Actions émises en circulation	34 584	25 077	12 640
VNI par action	$ 10,59	$ 12,00	$ 12,17
Distribution	$ 65 549	$ 25 309	$ 19 510
Actions émises en circulation	7 213	2 428	1 826
VNI par action	$ 9,09	$ 10,43	$ 10,68
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 454 679	CHF 22 579	CHF 16 793
Actions émises en circulation	49 550	2 115	1 534
VNI par action	CHF 9,18	CHF 10,67	CHF 10,94
Institutions en EUR (exposition au risque de change) :			
Capitalisation	€ 3 933	€ 856	S/O
Actions émises en circulation	444	86	S/O
VNI par action	€ 8,85	€ 9,96	S/O
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 957 548	€ 623 870	€ 276 328
Actions émises en circulation	101 940	57 390	24 851
VNI par action	€ 9,39	€ 10,87	€ 11,12
Distribution	€ 92 352	€ 111 407	€ 165 370
Actions émises en circulation	10 695	11 012	15 815
VNI par action	€ 8,63	€ 10,12	€ 10,46
Institutions en GBP (exposition au risque de change) :			
Distribution	£ 8	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	£ 9,55	S/O	S/O
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 2 394	£ 16 849	£ 13 241
Actions émises en circulation	266	1 634	1 264
VNI par action	£ 9,03	£ 10,31	£ 10,48
Distribution	£ 84 397	£ 75 165	£ 43 778
Actions émises en circulation	9 242	7 117	4 037
VNI par action	£ 9,13	£ 10,56	£ 10,84
Institutions en GBP (non couverte) :			
Distribution	£ 20 996	£ 23 387	£ 7
Actions émises en circulation	2 240	2 448	1
VNI par action	£ 9,37	£ 9,55	£ 9,70
Institutions en NOK (couverte) :			
Capitalisation	NOK 5 366 868	NOK 5 205 593	NOK 4 228 645
Actions émises en circulation	531 175	450 696	360 891
VNI par action	NOK 10,10	NOK 11,55	NOK 11,72
Institutions en NZD (couverte) :			
Distribution	NZD 64 722	NZD 74 299	NZD 68 677
Actions émises en circulation	6 755	6 732	6 078
VNI par action	NZD 9,58	NZD 11,04	NZD 11,30
Institutions en SEK (couverte) :			
Capitalisation	SEK 504 943	SEK 568 764	S/O
Actions émises en circulation	5 807	5 678	S/O
VNI par action	SEK 86,95	SEK 100,17	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds Global Bond ESG Fund (suite)		
Investisseurs :			
Capitalisation	$ 8 195	$ 12 127	$ 18 700
Actions émises en circulation	811	1 055	1 600
VNI par action	$ 10,10	$ 11,49	$ 11,69
Administrations :			
Capitalisation	S/O	$ 2 318	$ 11
Actions émises en circulation	S/O	208	1
VNI par action	S/O	$ 11,12	$ 11,34
Distribution	S/O	$ 11	$ 11
Actions émises en circulation	S/O	1	1
VNI par action	S/O	$ 10,82	$ 11,09
Catégorie E :			
Distribution	$ 3 846	$ 2 115	$ 6 261
Actions émises en circulation	408	196	565
VNI par action	$ 9,42	$ 10,81	$ 11,08
Catégorie E en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 77	S/O	S/O
Actions émises en circulation	8	S/O	S/O
VNI par action	CHF 9,66	S/O	S/O
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 38 263	€ 48 847	€ 44 524
Actions émises en circulation	4 288	4 688	4 140
VNI par action	€ 8,92	€ 10,42	€ 10,76
Catégorie Z en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 356 037	AUD 250 833	AUD 98 588
Actions émises en circulation	37 495	22 777	8 716
VNI par action	AUD 9,50	AUD 11,01	AUD 11,31
	Fonds Global Bond Ex-US Fund		
Actif net	$ 716 022	$ 911 707	$ 929 980
Institutions :			
Capitalisation	$ 420 156	$ 527 915	$ 493 644
Actions émises en circulation	18 790	21 249	19 620
VNI par action	$ 22,36	$ 24,84	$ 25,16
Distribution	$ 32 820	$ 52 506	$ 46 004
Actions émises en circulation	2 206	3 117	2 652
VNI par action	$ 14,88	$ 16,85	$ 17,35
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 45 032	€ 23 841	€ 35 120
Actions émises en circulation	2 816	1 315	1 898
VNI par action	€ 15,99	€ 18,13	€ 18,50
Institutions en GBP (couverte) :			
Distribution	S/O	S/O	£ 210
Actions émises en circulation	S/O	S/O	20
VNI par action	S/O	S/O	£ 10,54
Investisseurs :			
Capitalisation	$ 6 657	$ 17 194	$ 21 037
Actions émises en circulation	316	732	881
VNI par action	$ 21,07	$ 23,49	$ 23,88
Administrations :			
Capitalisation	$ 10 720	$ 12 451	$ 10 624
Actions émises en circulation	525	546	458
VNI par action	$ 20,41	$ 22,79	$ 23,19
Catégorie E :			
Distribution	$ 23 336	$ 54 115	$ 46 592
Actions émises en circulation	1 615	3 309	2 766
VNI par action	$ 14,45	$ 16,36	$ 16,84
Catégorie E (exposition au risque de change) :			
Distribution	$ 62 837	$ 81 361	$ 56 847
Actions émises en circulation	7 858	8 142	5 213
VNI par action	$ 8,00	$ 9,99	$ 10,91

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds Global Bond Ex-US Fund (suite)		
H Institutions :			
Capitalisation	$ 6 714	$ 1 160	$ 73 013
Actions émises en circulation	667	104	6 428
VNI par action	$ 10,06	$ 11,20	$ 11,36
Catégorie Z :			
Capitalisation	$ 104 722	$ 137 893	$ 138 962
Actions émises en circulation	10 957	13 049	13 049
VNI par action	$ 9,56	$ 10,57	$ 10,65
	Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		
Actif net	$ 750 076	$ 1 035 021	$ 702 430
Institutions :			
Capitalisation	$ 30 140	$ 37 389	$ 45 298
Actions émises en circulation	1 526	1 571	2 116
VNI par action	$ 19,74	$ 23,80	$ 21,41
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 204 979	€ 352 099	€ 123 732
Actions émises en circulation	11 632	16 474	6 469
VNI par action	€ 17,62	€ 21,37	€ 19,13
Institutions en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 3 301	£ 4 301	£ 4 026
Actions émises en circulation	331	345	349
VNI par action	£ 9,99	£ 12,45	£ 11,55
Investisseurs :			
Capitalisation	$ 10 303	$ 10 116	$ 9 158
Actions émises en circulation	704	571	573
VNI par action	$ 14,63	$ 17,70	$ 15,98
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 32 627	$ 40 303	$ 33 696
Actions émises en circulation	1 942	1 966	1 806
VNI par action	$ 16,80	$ 20,50	$ 18,66
Distribution	$ 13 011	$ 13 372	$ 8 100
Actions émises en circulation	1 448	1 172	749
VNI par action	$ 8,98	$ 11,41	$ 10,81
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 217 239	€ 230 733	€ 205 357
Actions émises en circulation	14 494	12 541	12 325
VNI par action	€ 14,99	€ 18,40	€ 16,66
Distribution	€ 49 389	€ 57 708	€ 42 548
Actions émises en circulation	6 071	5 551	4 342
VNI par action	€ 8,14	€ 10,40	€ 9,80
H Institutions :			
Capitalisation	$ 9	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	$ 9,43	S/O	S/O
Distribution	$ 9	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	$ 9,18	S/O	S/O
Catégorie Z :			
Capitalisation	$ 156 684	$ 199 594	$ 145 959
Actions émises en circulation	10 644	11 355	9 320
VNI par action	$ 14,72	$ 17,58	$ 15,66
	Fonds Global High Yield Bond Fund		
Actif net	$ 3 102 868	$ 5 169 160	$ 5 403 543
Institutions :			
Capitalisation	$ 579 939	$ 844 967	$ 1 065 384
Actions émises en circulation	22 368	29 240	38 174
VNI par action	$ 25,93	$ 28,90	$ 27,91
Distribution	$ 292 202	$ 489 734	$ 349 849
Actions émises en circulation	29 927	42 937	30 507
VNI par action	$ 9,76	$ 11,41	$ 11,47

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds Global High Yield Bond Fund (suite)		
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 22 915	CHF 38 082	CHF 40 299
Actions émises en circulation	1 439	2 089	2 265
VNI par action	CHF 15,92	CHF 18,23	CHF 17,79
Distribution	CHF 3 237	CHF 16 630	CHF 18 324
Actions émises en circulation	436	1 863	2 019
VNI par action	CHF 7,43	CHF 8,93	CHF 9,08
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 725 182	€ 1 232 938	€ 1 149 182
Actions émises en circulation	32 640	48 671	46 572
VNI par action	€ 22,22	€ 25,33	€ 24,68
Distribution	€ 155 150	€ 119 724	€ 109 781
Actions émises en circulation	15 853	10 243	9 253
VNI par action	€ 9,79	€ 11,69	€ 11,86
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 31 335	£ 239 206	£ 96 397
Actions émises en circulation	2 130	14 437	6 007
VNI par action	£ 14,71	£ 16,57	£ 16,05
Distribution	£ 292 800	£ 557 487	£ 642 574
Actions émises en circulation	59 445	95 775	109 465
VNI par action	£ 4,93	£ 5,82	£ 5,87
Investisseurs :			
Capitalisation	$ 1 820	$ 12 295	$ 12 417
Actions émises en circulation	149	902	940
VNI par action	$ 12,19	$ 13,64	$ 13,21
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 12 416	€ 5 703	€ 3 311
Actions émises en circulation	583	234	139
VNI par action	€ 21,30	€ 24,37	€ 23,83
Administrations :			
Capitalisation	$ 30 795	$ 50 855	$ 47 282
Actions émises en circulation	1 276	1 881	1 802
VNI par action	$ 24,14	$ 27,04	$ 26,24
Distribution	$ 21 259	$ 32 985	$ 29 675
Actions émises en circulation	2 225	2 956	2 644
VNI par action	$ 9,56	$ 11,16	$ 11,22
Administrations en EUR (couverte) :			
Distribution	S/O	€ 1 908	€ 2 201
Actions émises en circulation	S/O	196	223
VNI par action	S/O	€ 9,71	€ 9,85
Administrations en GBP (couverte) :			
Distribution	S/O	£ 1 111	£ 1 475
Actions émises en circulation	S/O	106	140
VNI par action	S/O	£ 10,44	£ 10,53
BM Détail :			
Distribution II	$ 10	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	$ 9,34	S/O	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 129 353	$ 186 558	$ 210 078
Actions émises en circulation	5 776	7 407	8 558
VNI par action	$ 22,40	$ 25,19	$ 24,55
Distribution	$ 109 532	$ 151 015	$ 224 794
Actions émises en circulation	11 389	13 453	19 913
VNI par action	$ 9,62	$ 11,23	$ 11,29
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 224 727	€ 299 451	€ 288 006
Actions émises en circulation	10 424	12 074	11 814
VNI par action	€ 21,56	€ 24,80	€ 24,38
Distribution	€ 27 782	€ 38 159	€ 43 265
Actions émises en circulation	3 472	3 992	4 460
VNI par action	€ 8,00	€ 9,56	€ 9,70

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds Global High Yield Bond Fund (suite)		
Catégorie E en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 5 932	£ 7 285	£ 7 198
Actions émises en circulation	572	595	583
VNI par action	£ 10,38	£ 12,25	£ 12,36
Catégorie E en SGD (couverte) :			
Distribution	SGD 6 387	SGD 11 731	SGD 9 093
Actions émises en circulation	711	1 116	860
VNI par action	SGD 8,98	SGD 10,52	SGD 10,57
H Institutions :			
Capitalisation	$ 218 500	$ 82 082	$ 240 370
Actions émises en circulation	8 771	2 952	8 934
VNI par action	$ 24,91	$ 27,81	$ 26,91
Distribution	$ 4 003	$ 10 759	$ 9 847
Actions émises en circulation	462	1 064	968
VNI par action	$ 8,66	$ 10,11	$ 10,17
M Détail :			
Distribution	$ 17 710	$ 25 552	$ 30 491
Actions émises en circulation	1 865	2 306	2 736
VNI par action	$ 9,50	$ 11,08	$ 11,14
Distribution II	$ 35 654	$ 107 627	$ 49 638
Actions émises en circulation	4 652	11 857	5 358
VNI par action	$ 7,66	$ 9,08	$ 9,26
Catégorie R :			
Capitalisation	$ 2 617	$ 73 221	$ 73 682
Actions émises en circulation	184	4 598	4 779
VNI par action	$ 14,25	$ 15,92	$ 15,42
Catégorie T :			
Capitalisation	$ 5 339	$ 7 458	$ 7 892
Actions émises en circulation	448	554	599
VNI par action	$ 11,93	$ 13,47	$ 13,18
Distribution	$ 1 796	$ 2 373	$ 2 703
Actions émises en circulation	200	227	257
VNI par action	$ 8,96	$ 10,46	$ 10,52
Catégorie T en EUR (couverte) :			
Capitalisation	S/O	€ 1 450	€ 1 448
Actions émises en circulation	S/O	130	132
VNI par action	S/O	€ 11,14	€ 11,00
	Fonds Global Investment Grade Credit Fund		
Actif net	$ 10 538 341	$ 17 154 925	$ 28 178 170
Institutions :			
Capitalisation	$ 2 618 560	$ 3 806 107	$ 5 463 978
Actions émises en circulation	140 682	172 781	244 589
VNI par action	$ 18,61	$ 22,03	$ 22,34
Distribution	$ 474 941	$ 705 907	$ 1 176 158
Actions émises en circulation	44 276	53 902	86 159
VNI par action	$ 10,73	$ 13,10	$ 13,65
Institutions (exposition au risque de change) :			
Capitalisation	$ 100 855	$ 86 823	$ 135 818
Actions émises en circulation	7 439	5 244	7 905
VNI par action	$ 13,56	$ 16,56	$ 17,18

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)		
Distribution	$ 22 435	$ 33 395	$ 46 397
Actions émises en circulation	2 833	3 347	4 359
VNI par action	$ 7,92	$ 9,98	$ 10,64
Institutions en AUD (couverte) :			
Distribution	AUD 7 370	AUD 90 155	AUD 193 406
Actions émises en circulation	861	8 528	17 513
VNI par action	AUD 8,56	AUD 10,57	AUD 11,04
Institutions en CAD (couverte) :			
Distribution	S/O	CAD 12	S/O
Actions émises en circulation	S/O	1	S/O
VNI par action	S/O	CAD 9,70	S/O
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 656 465	CHF 814 188	CHF 1 033 114
Actions émises en circulation	44 353	45 260	56 019
VNI par action	CHF 14,80	CHF 17,99	CHF 18,44
Distribution	CHF 33 474	CHF 49 517	CHF 64 939
Actions émises en circulation	4 674	5 516	6 862
VNI par action	CHF 7,16	CHF 8,98	CHF 9,46
Institutions en CZK (couverte) :			
Distribution	CZK 339 010	CZK 2 085 033	CZK 2 321 368
Actions émises en circulation	41 499	216 797	232 003
VNI par action	CZK 8,17	CZK 9,62	CZK 10,01
Institutions en EUR (exposition au risque de change) :			
Capitalisation	€ 43 714	€ 39 844	€ 19 426
Actions émises en circulation	3 441	2 737	1 383
VNI par action	€ 12,70	€ 14,56	€ 14,04
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 1 343 974	€ 2 237 224	€ 3 901 877
Actions émises en circulation	79 965	109 970	187 485
VNI par action	€ 16,81	€ 20,34	€ 20,81
Distribution	€ 447 965	€ 803 485	€ 740 139
Actions émises en circulation	47 525	68 258	59 770
VNI par action	€ 9,43	€ 11,77	€ 12,38
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 112 550	£ 258 867	£ 443 999
Actions émises en circulation	6 014	11 576	19 545
VNI par action	£ 18,72	£ 22,36	£ 22,72
Distribution	£ 767 395	£ 1 684 722	£ 3 908 795
Actions émises en circulation	69 403	123 537	274 389
VNI par action	£ 11,06	£ 13,64	£ 14,25
Institutions en HUF (couverte) :			
Distribution	S/O	HUF 9 873 261	HUF 9 940 031
Actions émises en circulation	S/O	1 025 701	995 298
VNI par action	S/O	HUF 9,63	HUF 9,99
Institutions en ILS (couverte) :			
Capitalisation	S/O	ILS 9 004	ILS 231 711
Actions émises en circulation	S/O	531	13 394
VNI par action	S/O	ILS 16,96	ILS 17,30

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)						
Institutions en NOK (couverte) :						
Capitalisation	NOK	258 128	NOK	429 061	NOK	452 970
Actions émises en circulation		1 931		2 683		2 793
VNI par action	NOK	133,69	NOK	159,90	NOK	162,17
Institutions en PLN (couverte) :						
Distribution		S/O	PLN	120 869	PLN	24 867
Actions émises en circulation		S/O		11 435		2 257
VNI par action		S/O	PLN	10,57	PLN	11,02
Institutions en SEK (couverte) :						
Capitalisation	SEK	2 527 557	SEK	3 657 935	SEK	4 033 636
Actions émises en circulation		176 118		211 649		228 950
VNI par action	SEK	14,35	SEK	17,28	SEK	17,62
Institutions en SGD (couverte) :						
Distribution	SGD	11 301	SGD	8 028	SGD	53 885
Actions émises en circulation		1 291		749		4 827
VNI par action	SGD	8,76	SGD	10,72	SGD	11,16
Investisseurs :						
Capitalisation	$	440 714	$	988 957	$	1 715 463
Actions émises en circulation		21 729		41 056		69 981
VNI par action	$	20,28	$	24,09	$	24,51
Distribution	$	131 169	$	92 275	$	272 490
Actions émises en circulation		11 489		6 624		18 766
VNI par action	$	11,42	$	13,93	$	14,52
Investisseurs en AUD (couverte) :						
Distribution	AUD	10 542	AUD	5 854	AUD	8 681
Actions émises en circulation		1 256		565		802
VNI par action	AUD	8,39	AUD	10,37	AUD	10,83
Investisseurs en CAD (couverte) :						
Distribution		S/O	CAD	1 822	CAD	3 272
Actions émises en circulation		S/O		175		300
VNI par action		S/O	CAD	10,44	CAD	10,89
Investisseurs en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	5 359	CHF	7 624	CHF	8 313
Actions émises en circulation		494		577		611
VNI par action	CHF	10,84	CHF	13,22	CHF	13,60
Distribution	CHF	5 334	CHF	8 176	CHF	10 171
Actions émises en circulation		578		707		834
VNI par action	CHF	9,23	CHF	11,56	CHF	12,19
Investisseurs en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	26 086	€	49 619	€	71 993
Actions émises en circulation		1 646		2 577		3 643
VNI par action	€	15,85	€	19,25	€	19,76
Distribution	€	11 379	€	16 646	€	16 947
Actions émises en circulation		1 151		1 349		1 306
VNI par action	€	9,88	€	12,34	€	12,98
Investisseurs en GBP (couverte) :						
Distribution	£	4 175	£	5 735	£	8 458
Actions émises en circulation		389		433		612
VNI par action	£	10,73	£	13,23	£	13,82

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)						
Investisseurs en RMB (couverte) :						
Distribution		S/O	CNH	3 345	CNH	7 674
Actions émises en circulation		S/O		30		67
VNI par action		S/O	CNH	111,93	CNH	113,76
Investisseurs en SGD (couverte) :						
Distribution	SGD	7 277	SGD	7 473	SGD	20 558
Actions émises en circulation		852		715		1 889
VNI par action	SGD	8,54	SGD	10,45	SGD	10,89
Administrations :						
Capitalisation	$	76 931	$	215 743	$	241 443
Actions émises en circulation		4 431		10 444		11 468
VNI par action	$	17,36	$	20,66	$	21,05
Distribution	$	47 290	$	99 369	$	290 320
Actions émises en circulation		4 285		7 378		20 679
VNI par action	$	11,04	$	13,47	$	14,04
Administrations en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	391	CHF	629	CHF	1 583
Actions émises en circulation		41		54		132
VNI par action	CHF	9,54	CHF	11,65	CHF	12,01
Administrations en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	7 522	€	9 518	€	21 800
Actions émises en circulation		503		523		1 165
VNI par action	€	14,97	€	18,21	€	18,72
Distribution	€	7 846	€	9 315	€	13 726
Actions émises en circulation		822		782		1 095
VNI par action	€	9,54	€	11,91	€	12,53
Administrations en GBP (couverte) :						
Distribution	£	4 557	£	6 985	£	9 572
Actions émises en circulation		427		531		696
VNI par action	£	10,68	£	13,17	£	13,75
Administrations en HKD (non couverte) :						
Distribution	HKD	10 505	HKD	12 810	HKD	40 974
Actions émises en circulation		1 244		1 244		3 837
VNI par action	HKD	8,44	HKD	10,30	HKD	10,68
Administrations en SEK (couverte) :						
Capitalisation	SEK	901 901	SEK	936 226	SEK	1 214 895
Actions émises en circulation		88 869		76 221		96 543
VNI par action	SEK	10,15	SEK	12,28	SEK	12,58
Administrations en SGD (couverte) :						
Distribution	SGD	2 918	SGD	5 459	SGD	48 256
Actions émises en circulation		354		542		4 597
VNI par action	SGD	8,24	SGD	10,08	SGD	10,50
Catégorie E :						
Capitalisation	$	605 749	$	799 659	$	1 314 292
Actions émises en circulation		36 905		40 796		65 526
VNI par action	$	16,41	$	19,60	$	20,06
Distribution	$	216 440	$	341 550	$	615 957
Actions émises en circulation		18 589		24 037		41 586
VNI par action	$	11,64	$	14,21	$	14,81
Catégorie E en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	52 629	CHF	78 253	CHF	87 585
Actions émises en circulation		5 342		6 476		7 007
VNI par action	CHF	9,85	CHF	12,08	CHF	12,50
Catégorie E en EUR (exposition au risque de change) :						
Distribution	€	1 340	€	3 077	€	4 671
Actions émises en circulation		148		288		441
VNI par action	€	9,03	€	10,67	€	10,58
Catégorie E en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	451 796	€	630 730	€	767 585
Actions émises en circulation		31 264		35 735		42 129
VNI par action	€	14,45	€	17,65	€	18,22

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)			
Distribution	€ 197 011	€ 271 438	€ 354 267
Actions émises en circulation	24 230	26 741	33 181
VNI par action	€ 8,13	€ 10,15	€ 10,68
Catégorie E en GBP (couverte) : Distribution	£ 20 979	£ 31 335	£ 44 366
Actions émises en circulation	1 881	2 279	3 090
VNI par action	£ 11,15	£ 13,75	£ 14,36
Catégorie E en SGD (couverte) : Distribution	SGD 30 453	SGD 37 343	SGD 84 734
Actions émises en circulation	3 472	3 481	7 583
VNI par action	SGD 8,77	SGD 10,73	SGD 11,17
H Institutions : Capitalisation	$ 282 176	$ 168 210	$ 358 146
Actions émises en circulation	14 572	7 327	15 358
VNI par action	$ 19,36	$ 22,96	$ 23,32
Distribution	$ 17 320	$ 14 287	$ 12 263
Actions émises en circulation	2 000	1 351	1 113
VNI par action	$ 8,66	$ 10,57	$ 11,02
H Institutions (exposition au risque de change) : Capitalisation	$ 184 082	$ 10	S/O
Actions émises en circulation	22 850	1	S/O
VNI par action	$ 8,06	$ 9,85	S/O
M Détail : Distribution	$ 25 037	$ 49 229	$ 120 020
Actions émises en circulation	2 840	4 577	10 705
VNI par action	$ 8,82	$ 10,76	$ 11,21
Distribution II	$ 86 672	$ 120 251	$ 189 177
Actions émises en circulation	10 861	12 179	18 129
VNI par action	$ 7,98	$ 9,87	$ 10,43
M Détail en HKD (non couverte) : Distribution	HKD 8 376	HKD 9 145	HKD 56 230
Actions émises en circulation	990	887	5 264
VNI par action	HKD 8,46	HKD 10,31	HKD 10,68
Catégorie R : Capitalisation	$ 16 316	$ 28 433	$ 38 196
Actions émises en circulation	1 381	2 028	2 679
VNI par action	$ 11,81	$ 14,02	$ 14,26
Distribution	$ 4 870	$ 6 925	$ 8 289
Actions émises en circulation	558	650	746
VNI par action	$ 8,73	$ 10,66	$ 11,11
Catégorie R en EUR (couverte) : Distribution	€ 2 758	€ 6 026	€ 9 645
Actions émises en circulation	364	636	968
VNI par action	€ 7,59	€ 9,47	€ 9,97
Catégorie R en GBP (couverte) : Distribution	£ 8 117	£ 11 449	£ 26 041
Actions émises en circulation	998	1 141	2 485
VNI par action	£ 8,14	£ 10,04	£ 10,48
Catégorie T : Capitalisation	$ 28 595	$ 42 303	$ 61 567
Actions émises en circulation	2 786	3 438	4 870
VNI par action	$ 10,26	$ 12,30	$ 12,64
Catégorie T en EUR (couverte) : Capitalisation	€ 3 508	€ 4 875	€ 7 585
Actions émises en circulation	393	446	669
VNI par action	€ 8,92	€ 10,94	€ 11,34
Catégorie W : Capitalisation	$ 32 822	$ 66 615	$ 70 586
Actions émises en circulation	3 811	6 543	6 843
VNI par action	$ 8,61	$ 10,18	$ 10,32

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds Global Investment Grade Credit Fund (suite)			
Distribution	$ 11 533	$ 20 732	$ 30 591
Actions émises en circulation	1 437	2 116	2 996
VNI par action	$ 8,03	$ 9,80	$ 10,21
Catégorie W en CHF (couverte) : Capitalisation	CHF 20 144	CHF 32 864	CHF 36 879
Actions émises en circulation	2 440	3 278	3 592
VNI par action	CHF 8,26	CHF 10,03	CHF 10,27
Catégorie W en EUR (couverte) : Capitalisation	€ 14 812	€ 150 079	€ 14 050
Actions émises en circulation	1 781	14 925	1 367
VNI par action	€ 8,31	€ 10,06	€ 10,28
Distribution	€ 2 194	€ 3 545	€ 4 089
Actions émises en circulation	283	367	402
VNI par action	€ 7,74	€ 9,67	€ 10,17
Catégorie W en GBP (couverte) : Capitalisation	£ 3 270	£ 515	£ 8
Actions émises en circulation	385	51	1
VNI par action	£ 8,50	£ 10,15	£ 10,30
Distribution	£ 6 970	£ 16 284	£ 15 521
Actions émises en circulation	881	1 668	1 521
VNI par action	£ 7,92	£ 9,76	£ 10,20
Catégorie W en SGD (couverte) : Distribution	SGD 4 506	SGD 810	SGD 14
Actions émises en circulation	563	83	1
VNI par action	SGD 8,01	SGD 9,79	SGD 10,20
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund			
Actif net	$ 1 369 890	$ 1 189 563	$ 332 010
Institutions : Capitalisation	$ 61 632	$ 39 212	$ 42 254
Actions émises en circulation	5 924	3 211	3 426
VNI par action	$ 10,40	$ 12,21	$ 12,33
Distribution	$ 10 347	$ 19 429	$ 29 531
Actions émises en circulation	1 167	1 825	2 706
VNI par action	$ 8,86	$ 10,65	$ 10,91
Institutions en CHF (couverte) : Capitalisation	CHF 190 278	CHF 185 627	CHF 54 442
Actions émises en circulation	20 258	16 381	4 707
VNI par action	CHF 9,39	CHF 11,33	CHF 11,57
Distribution	CHF 2 020	CHF 3 002	CHF 200
Actions émises en circulation	253	304	19
VNI par action	CHF 8,00	CHF 9,88	CHF 10,24
Institutions en EUR (couverte) : Capitalisation	€ 220 186	€ 229 148	€ 49 683
Actions émises en circulation	23 072	19 996	4 257
VNI par action	€ 9,54	€ 11,46	€ 11,67
Distribution	€ 320 757	€ 42 749	€ 23 021
Actions émises en circulation	39 702	4 306	2 243
VNI par action	€ 8,08	€ 9,93	€ 10,26
Institutions en GBP (couverte) : Capitalisation	£ 72 284	£ 83 370	£ 15 049
Actions émises en circulation	7 283	7 085	1 264
VNI par action	£ 9,92	£ 11,77	£ 11,90
Distribution	£ 87 512	£ 155 708	£ 10 023
Actions émises en circulation	9 955	14 592	915
VNI par action	£ 8,79	£ 10,67	£ 10,96
Institutions en SEK (couverte) : Capitalisation	SEK 11 028	S/O	S/O
Actions émises en circulation	106	S/O	S/O
VNI par action	SEK 103,64	S/O	S/O

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
	Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund (suite)					
Investisseurs :						
Capitalisation	$	217	$	141		S/O
Actions émises en circulation		25		14		S/O
VNI par action	$	8,56	$	10,09		S/O
Administrations en SEK (couverte) :						
Capitalisation	SEK	3 047 191	SEK	2 293 688	SEK	349 070
Actions émises en circulation		35 030		21 953		3 274
VNI par action	SEK	86,99	SEK	104,48	SEK	106,61
Catégorie E :						
Capitalisation	$	1 735	$	3 820	$	10 591
Actions émises en circulation		200		372		1 011
VNI par action	$	8,68	$	10,28	$	10,47
Distribution	$	446	$	834	$	3 531
Actions émises en circulation		53		82		339
VNI par action	$	8,45	$	10,15	$	10,40
Catégorie E en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	491	CHF	194	CHF	1 953
Actions émises en circulation		60		19		189
VNI par action	CHF	8,22	CHF	10,01	CHF	10,31
Distribution	CHF	24	CHF	30	CHF	31
Actions émises en circulation		3		3		3
VNI par action	CHF	8,00	CHF	9,87	CHF	10,23
Catégorie E en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	3 370	€	7 130	€	6 631
Actions émises en circulation		406		709		642
VNI par action	€	8,29	€	10,05	€	10,33
Distribution	€	581	€	869	€	561
Actions émises en circulation		72		88		55
VNI par action	€	8,07	€	9,92	€	10,25
Catégorie E en GBP (couverte) :						
Capitalisation	£	420	£	503	£	532
Actions émises en circulation		50		50		51
VNI par action	£	8,49	£	10,16	£	10,37
Distribution		S/O	£	104	£	114
Actions émises en circulation		S/O		10		11
VNI par action		S/O	£	10,02	£	10,29
Catégorie Z :						
Capitalisation	$	19 339	$	22 582	$	6 627
Actions émises en circulation		1 986		1 986		580
VNI par action	$	9,74	$	11,37	$	11,43
	Fonds Global Low Duration Real Return Fund					
Actif net	$	1 364 375	$	1 199 076	$	787 871
Institutions :						
Capitalisation	$	136 292	$	150 363	$	121 782
Actions émises en circulation		11 554		12 580		10 630
VNI par action	$	11,80	$	11,95	$	11,46
Institutions en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	22 752	CHF	32 711	CHF	10 894
Actions émises en circulation		2 303		3 190		1 097
VNI par action	CHF	9,88	CHF	10,25	CHF	9,93

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
	Fonds Global Low Duration Real Return Fund (suite)					
Institutions en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	498 384	€	518 804	€	360 889
Actions émises en circulation		48 614		48 941		35 221
VNI par action	€	10,25	€	10,60	€	10,25
Distribution	€	34 131	€	45 289	€	39 196
Actions émises en circulation		3 856		4 630		4 002
VNI par action	€	8,85	€	9,78	€	9,79
Institutions en GBP (couverte) :						
Capitalisation	£	55 816	£	63 979	£	32 234
Actions émises en circulation		5 128		5 771		3 025
VNI par action	£	10,88	£	11,09	£	10,66
Distribution	£	62 640	£	57 902	£	31 115
Actions émises en circulation		6 761		5 720		3 085
VNI par action	£	9,26	£	10,12	£	10,09
Institutions en SGD (couverte) :						
Capitalisation	SGD	351 313		S/O		S/O
Actions émises en circulation		34 943		S/O		S/O
VNI par action	SGD	10,05		S/O		S/O
Investisseurs :						
Capitalisation	$	6 751	$	5 146	$	3 787
Actions émises en circulation		591		443		339
VNI par action	$	11,42	$	11,61	$	11,17
Catégorie E :						
Capitalisation	$	34 924	$	26 574	$	15 858
Actions émises en circulation		3 206		2 386		1 472
VNI par action	$	10,89	$	11,14	$	10,77
Catégorie E en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	177 147	€	153 469	€	47 404
Actions émises en circulation		18 721		15 545		4 923
VNI par action	€	9,46	€	9,87	€	9,63
	Fonds Global Real Return Fund					
Actif net	$	2 571 862	$	3 703 379	$	2 578 062
Institutions :						
Capitalisation	$	272 591	$	380 827	$	220 950
Actions émises en circulation		12 628		14 784		9 004
VNI par action	$	21,59	$	25,76	$	24,54
Distribution	$	12 328	$	22 531	$	26 256
Actions émises en circulation		796		1 136		1 349
VNI par action	$	15,49	$	19,84	$	19,47
Institutions (exposition au risque de change) :						
Capitalisation	$	47 075	$	68 405	$	84 232
Actions émises en circulation		4 828		5 543		7 004
VNI par action	$	9,75	$	12,34	$	12,03
Institutions en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	56 131	CHF	63 005	CHF	52 289
Actions émises en circulation		4 267		3 907		3 366
VNI par action	CHF	13,15	CHF	16,12	CHF	15,53
Distribution	CHF	33 615	CHF	38 988	CHF	36 335
Actions émises en circulation		3 898		3 438		3 228
VNI par action	CHF	8,62	CHF	11,34	CHF	11,26
Institutions en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	824 251	€	1 075 404	€	796 538
Actions émises en circulation		45 572		48 681		37 555
VNI par action	€	18,09	€	22,09	€	21,21
Distribution	€	98 750	€	140 728	€	152 140
Actions émises en circulation		7 750		8 415		9 195
VNI par action	€	12,74	€	16,72	€	16,55

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds Global Real Return Fund (suite)		
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 38 820	£ 45 209	£ 33 719
Actions émises en circulation	3 298	3 177	2 484
VNI par action	£ 11,77	£ 14,23	£ 13,57
Distribution	£ 205 454	£ 276 097	£ 83 894
Actions émises en circulation	25 531	26 297	8 128
VNI par action	£ 8,05	£ 10,50	£ 10,32
Institutions en SGD (couverte) :			
Capitalisation	SGD 236 796	SGD 307 106	SGD 157 065
Actions émises en circulation	14 984	16 250	8 732
VNI par action	SGD 15,80	SGD 18,90	SGD 17,99
Investisseurs :			
Capitalisation	$ 63 935	$ 92 993	$ 70 699
Actions émises en circulation	3 170	3 850	3 062
VNI par action	$ 20,17	$ 24,16	$ 23,09
Distribution	$ 9 038	$ 31 044	$ 21 532
Actions émises en circulation	669	1 795	1 269
VNI par action	$ 13,51	$ 17,30	$ 16,97
Investisseurs en CHF (couverte) :			
Distribution	CHF 2 516	CHF 5 139	CHF 4 219
Actions émises en circulation	232	360	298
VNI par action	CHF 10,85	CHF 14,28	CHF 14,17
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 22 838	€ 36 406	€ 15 265
Actions émises en circulation	1 347	1 752	763
VNI par action	€ 16,95	€ 20,77	€ 20,02
Administrations :			
Capitalisation	$ 43 396	$ 71 230	$ 61 037
Actions émises en circulation	2 200	3 010	2 694
VNI par action	$ 19,73	$ 23,66	$ 22,65
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 153 574	$ 231 761	$ 157 612
Actions émises en circulation	8 292	10 391	7 352
VNI par action	$ 18,52	$ 22,30	$ 21,44
Distribution	$ 38 490	$ 53 098	$ 31 022
Actions émises en circulation	2 958	3 187	1 898
VNI par action	$ 13,01	$ 16,66	$ 16,35
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 234 441	€ 321 175	€ 217 762
Actions émises en circulation	15 090	16 773	11 740
VNI par action	€ 15,54	€ 19,15	€ 18,55
Catégorie E en GBP (couverte) :			
Distribution	S/O	£ 4 354	£ 2 597
Actions émises en circulation	S/O	282	171
VNI par action	S/O	£ 15,45	£ 15,19
H Institutions :			
Capitalisation	$ 90 138	$ 150 924	$ 49 942
Actions émises en circulation	4 307	6 032	2 092
VNI par action	$ 20,93	$ 25,02	$ 23,87
Catégorie R :			
Capitalisation	$ 1 569	$ 7 292	$ 1 921
Actions émises en circulation	132	514	142
VNI par action	$ 11,85	$ 14,18	$ 13,54
Catégorie R en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 8 283	£ 12 683	£ 13 745
Actions émises en circulation	747	944	1 069
VNI par action	£ 11,09	£ 13,44	£ 12,86

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds Income Fund		
Actif net	$ 57 980 327	$ 73 579 726	$ 71 275 311
Institutions :			
Capitalisation	$ 9 197 801	$ 10 989 198	$ 10 051 322
Actions émises en circulation	582 256	643 353	603 562
VNI par action	$ 15,80	$ 17,08	$ 16,65
Distribution	$ 4 597 148	$ 5 308 194	$ 4 407 646
Actions émises en circulation	435 389	442 049	362 996
VNI par action	$ 10,56	$ 12,01	$ 12,14
Institutions en AUD (couverte) :			
Capitalisation	AUD 80 591	AUD 96 588	AUD 88 881
Actions émises en circulation	7 611	8 329	7 836
VNI par action	AUD 10,59	AUD 11,60	AUD 11,34
Distribution	S/O	AUD 14	S/O
Actions émises en circulation	S/O	1	S/O
VNI par action	S/O	AUD 9,84	S/O
Institutions en BRL (couverte) :			
Capitalisation	$ 274 136	$ 561 362	$ 601 491
Actions émises en circulation	20 003	43 619	46 272
VNI par action	$ 13,70	$ 12,87	$ 13,00
Institutions en CAD (couverte) :			
Capitalisation	CAD 83 552	CAD 98 436	CAD 111 995
Actions émises en circulation	6 821	7 406	8 629
VNI par action	CAD 12,25	CAD 13,29	CAD 12,98
Distribution	CAD 117 940	CAD 138 770	CAD 127 606
Actions émises en circulation	12 956	13 346	12 097
VNI par action	CAD 9,10	CAD 10,40	CAD 10,55
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 293 823	CHF 326 885	CHF 273 775
Actions émises en circulation	26 495	26 540	22 558
VNI par action	CHF 11,09	CHF 12,32	CHF 12,14
Distribution	CHF 135 996	CHF 178 124	CHF 183 521
Actions émises en circulation	17 253	19 281	19 319
VNI par action	CHF 7,88	CHF 9,24	CHF 9,50
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 4 856 302	€ 6 397 698	€ 6 723 610
Actions émises en circulation	356 885	424 812	453 932
VNI par action	€ 13,61	€ 15,06	€ 14,81
Distribution	€ 858 841	€ 1 216 992	€ 963 725
Actions émises en circulation	96 621	117 285	90 563
VNI par action	€ 8,89	€ 10,38	€ 10,64
Distribution II	€ 13 739	€ 21 567	€ 58 118
Actions émises en circulation	1 555	2 138	5 750
VNI par action	€ 8,84	€ 10,09	€ 10,11
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 179 687	£ 223 422	£ 13 809
Actions émises en circulation	17 378	19 797	1 252
VNI par action	£ 10,34	£ 11,29	£ 11,03
Distribution	£ 437 940	£ 465 680	£ 426 938
Actions émises en circulation	48 401	44 776	40 380
VNI par action	£ 9,05	£ 10,40	£ 10,57

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
Fonds Income Fund (suite)						
Institutions en HKD (non couverte) :						
Distribution	HKD	448 226	HKD	798 164	HKD	796 572
Actions émises en circulation		46 468		72 832		72 285
VNI par action	HKD	9,65	HKD	10,96	HKD	11,02
Institutions en JPY (couverte) :						
Capitalisation		S/O	¥	255 548	¥	198 303
Actions émises en circulation		S/O		229		181
VNI par action		S/O	¥	1 118,00	¥	1 093,00
Institutions en NOK (couverte) :						
Capitalisation	NOK	2 153 310	NOK	2 187 743	NOK	2 157 697
Actions émises en circulation		19 915		18 488		18 680
VNI par action	NOK	108,13	NOK	118,34	NOK	115,51
Institutions en RMB (couverte) :						
Capitalisation		S/O	CNH	66		S/O
Actions émises en circulation		S/O		1		S/O
VNI par action		S/O	CNH	101,42		S/O
Institutions en SGD (couverte) :						
Capitalisation	SGD	57 007	SGD	46 472	SGD	2 335
Actions émises en circulation		5 614		4 222		218
VNI par action	SGD	10,15	SGD	11,01	SGD	10,73
Distribution	SGD	233 054	SGD	277 493	SGD	271 784
Actions émises en circulation		24 522		25 607		24 806
VNI par action	SGD	9,50	SGD	10,84	SGD	10,96
Investisseurs :						
Capitalisation	$	1 938 128	$	2 841 494	$	2 037 337
Actions émises en circulation		150 961		203 964		149 476
VNI par action	$	12,84	$	13,93	$	13,63
Distribution	$	1 424 611	$	1 709 869	$	1 314 008
Actions émises en circulation		152 992		160 791		121 625
VNI par action	$	9,31	$	10,63	$	10,80
Investisseurs en AUD (couverte) :						
Distribution	AUD	64 155	AUD	73 714	AUD	52 351
Actions émises en circulation		7 404		7 348		5 112
VNI par action	AUD	8,66	AUD	10,03	AUD	10,24
Investisseurs en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	212 831	€	508 040	€	1 450 102
Actions émises en circulation		19 702		42 352		122 489
VNI par action	€	10,80	€	12,00	€	11,84
Distribution	€	75 705	€	105 743	€	60 870
Actions émises en circulation		9 766		11 634		6 496
VNI par action	€	7,75	€	9,09	€	9,37
Distribution A	€	29 277	€	37 920	€	40 130
Actions émises en circulation		3 673		4 052		4 156
VNI par action	€	7,97	€	9,36	€	9,66
Investisseurs en GBP (couverte) :						
Distribution	£	16 799	£	9 219	£	3 920
Actions émises en circulation		1 965		935		390
VNI par action	£	8,55	£	9,86	£	10,04

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
Fonds Income Fund (suite)						
Investisseurs en RMB (couverte) :						
Capitalisation	CNH	66 886	CNH	124 077	CNH	252 069
Actions émises en circulation		579		994		2 117
VNI par action	CNH	115,46	CNH	124,87	CNH	119,09
Investisseurs en SGD (couverte) :						
Capitalisation	SGD	6 150	SGD	1 979	SGD	127
Actions émises en circulation		625		185		12
VNI par action	SGD	9,84	SGD	10,70	SGD	10,47
Distribution	SGD	47 450	SGD	67 208	SGD	37 559
Actions émises en circulation		5 340		6 605		3 630
VNI par action	SGD	8,89	SGD	10,18	SGD	10,35
Administrations :						
Capitalisation	$	744 526	$	912 059	$	631 493
Actions émises en circulation		65 457		73 786		52 139
VNI par action	$	11,37	$	12,36	$	12,11
Distribution	$	2 930 269	$	3 699 459	$	3 418 694
Actions émises en circulation		294 606		325 103		295 096
VNI par action	$	9,95	$	11,38	$	11,59
Administrations en AUD (couverte) :						
Distribution	AUD	286 887	AUD	316 049	AUD	355 413
Actions émises en circulation		32 273		30 677		33 782
VNI par action	AUD	8,89	AUD	10,30	AUD	10,52
Administrations en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	96 175	€	193 792	€	242 607
Actions émises en circulation		8 961		16 228		20 554
VNI par action	€	10,73	€	11,94	€	11,80
Distribution	€	266 419	€	308 049	€	331 791
Actions émises en circulation		33 865		33 362		34 844
VNI par action	€	7,87	€	9,23	€	9,52
Administrations en GBP (couverte) :						
Distribution	£	112 506	£	140 149	£	139 212
Actions émises en circulation		13 611		14 660		14 220
VNI par action	£	8,27	£	9,56	£	9,79
Administrations en HKD (non couverte) :						
Distribution	HKD	3 221 408	HKD	4 681 912	HKD	3 245 289
Actions émises en circulation		364 591		463 488		316 993
VNI par action	HKD	8,84	HKD	10,10	HKD	10,24
Administrations en JPY (couverte) :						
Capitalisation		S/O	¥	1 099		S/O
Actions émises en circulation		S/O		1		S/O
VNI par action		S/O	¥	999,00		S/O
Administrations en SGD (couverte) :						
Distribution	SGD	971 804	SGD	1 080 475	SGD	1 038 592
Actions émises en circulation		99 186		96 129		90 748
VNI par action	SGD	9,80	SGD	11,24	SGD	11,44
Catégorie E :						
Capitalisation	$	4 837 460	$	6 088 898	$	5 774 107
Actions émises en circulation		335 073		386 539		372 607
VNI par action	$	14,44	$	15,75	$	15,50
Distribution	$	6 857 888	$	8 765 914	$	7 968 268
Actions émises en circulation		723 233		804 221		714 149
VNI par action	$	9,48	$	10,90	$	11,16

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
Fonds Income Fund (suite)						
Distribution Q		S/O	$	2 029	$	1 841
Actions émises en circulation		S/O		203		180
VNI par action		S/O	$	10,01	$	10,24
Catégorie E en AUD (couverte) :						
Distribution	AUD	595 621	AUD	699 187	AUD	688 828
Actions émises en circulation		71 382		71 928		68 955
VNI par action	AUD	8,34	AUD	9,72	AUD	9,99
Catégorie E en CHF (couverte) :						
Capitalisation	CHF	80 590	CHF	101 113	CHF	98 769
Actions émises en circulation		7 568		8 472		8 323
VNI par action	CHF	10,65	CHF	11,93	CHF	11,87
Distribution	CHF	80 502	CHF	117 164	CHF	141 703
Actions émises en circulation		11 178		13 731		15 949
VNI par action	CHF	7,20	CHF	8,53	CHF	8,88
Catégorie E en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	4 356 288	€	5 062 678	€	4 783 315
Actions émises en circulation		350 614		364 865		347 362
VNI par action	€	12,42	€	13,88	€	13,77
Distribution	€	3 436 223	€	4 359 865	€	4 900 988
Actions émises en circulation		430 505		462 802		500 834
VNI par action	€	7,98	€	9,42	€	9,79
Distribution II	€	121 587	€	125 779	€	128 995
Actions émises en circulation		13 705		12 308		12 476
VNI par action	€	8,87	€	10,22	€	10,34
Distribution II Q	€	38 028	€	52 706	€	35 195
Actions émises en circulation		4 345		5 208		3 436
VNI par action	€	8,75	€	10,12	€	10,24
Catégorie E en GBP (couverte) :						
Distribution	£	208 926	£	236 936	£	254 166
Actions émises en circulation		26 188		25 560		26 639
VNI par action	£	7,98	£	9,27	£	9,54
Catégorie E en HKD (non couverte) :						
Distribution	HKD	3 442 414	HKD	4 704 540	HKD	5 569 457
Actions émises en circulation		385 795		459 225		534 050
VNI par action	HKD	8,92	HKD	10,24	HKD	10,43
Catégorie E en JPY (couverte) :						
Capitalisation	¥	4 076 871	¥	743 601	¥	2 647 085
Actions émises en circulation		4 248		692		2 495
VNI par action	¥	960,00	¥	1 075,00	¥	1 061,00
Distribution	¥	1 381		S/O		S/O
Actions émises en circulation		1		S/O		S/O
VNI par action	¥	992,00		S/O		S/O
Catégorie E en RMB (couverte) :						
Distribution	CNH	490 076	CNH	671 398	CNH	593 183
Actions émises en circulation		4 497		5 397		4 815
VNI par action	CNH	108,97	CNH	124,39	CNH	123,20
Catégorie E en SGD (couverte) :						
Distribution	SGD	2 537 340	SGD	2 784 269	SGD	2 701 956
Actions émises en circulation		292 512		278 445		263 912
VNI par action	SGD	8,67	SGD	10,00	SGD	10,24

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
Fonds Income Fund (suite)						
G Détail en EUR (couverte) :						
Distribution	€	18 496	€	29 724	€	35 845
Actions émises en circulation		2 393		3 263		3 801
VNI par action	€	7,73	€	9,11	€	9,43
G Détail en EUR (non couverte) :						
Distribution		S/O	€	518	€	275
Actions émises en circulation		S/O		51		29
VNI par action		S/O	€	10,11	€	9,55
H Institutions :						
Capitalisation	$	669 952	$	770 236	$	562 857
Actions émises en circulation		60 591		64 313		48 123
VNI par action	$	11,06	$	11,98	$	11,70
Distribution	$	287 285	$	333 808	$	299 508
Actions émises en circulation		31 482		32 084		28 375
VNI par action	$	9,13	$	10,40	$	10,56
H Institutions en EUR (couverte) :						
Capitalisation		S/O	€	8 530	€	2 672
Actions émises en circulation		S/O		772		245
VNI par action		S/O	€	11,05	€	10,89
Catégorie R :						
Capitalisation	$	82 073	$	70 929	$	31 223
Actions émises en circulation		8 054		6 420		2 892
VNI par action	$	10,19	$	11,05	$	10,80
Distribution	$	61 635	$	84 900	$	70 869
Actions émises en circulation		6 695		8 082		6 645
VNI par action	$	9,21	$	10,50	$	10,66
Catégorie R en EUR (couverte) :						
Distribution	€	12 865	€	16 112	€	14 929
Actions émises en circulation		1 567		1 678		1 514
VNI par action	€	8,21	€	9,60	€	9,86
Catégorie R en GBP (couverte) :						
Distribution	£	20 954	£	33 995	£	31 954
Actions émises en circulation		2 220		3 123		2 878
VNI par action	£	9,44	£	10,88	£	11,10
Catégorie T :						
Capitalisation	$	295 923	$	371 744	$	359 667
Actions émises en circulation		24 971		28 634		28 049
VNI par action	$	11,85	$	12,98	$	12,82
Distribution	$	102 600	$	130 671	$	131 492
Actions émises en circulation		12 279		13 542		13 244
VNI par action	$	8,36	$	9,65	$	9,93
Catégorie T en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	226 266	€	268 086	€	280 339
Actions émises en circulation		22 053		23 304		24 457
VNI par action	€	10,26	€	11,50	€	11,46
Distribution	€	165 117	€	217 088	€	252 475
Actions émises en circulation		23 351		25 890		28 837
VNI par action	€	7,07	€	8,38	€	8,76
Catégorie Z :						
Capitalisation	$	219 519	$	162 794	$	110 891
Actions émises en circulation		13 161		9 076		6 376
VNI par action	$	16,68	$	17,94	$	17,39

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
Fonds Income Fund (suite)						
Catégorie Z en AUD (couverte) :						
Distribution II	AUD	1 339 063	AUD	1 451 394	AUD	1 115 008
Actions émises en circulation		136 394		129 096		98 412
VNI par action	AUD	9,82	AUD	11,24	AUD	11,33
Fonds Income Fund II						
Actif net	$	56 623	$	27 770		S/O
Institutions :						
Capitalisation	$	22 431	$	24 374		S/O
Actions émises en circulation		2 396		2 396		S/O
VNI par action	$	9,35	$	10,17		S/O
Distribution		S/O	$	10		S/O
Actions émises en circulation		S/O		1		S/O
VNI par action		S/O	$	9,94		S/O
Catégorie E :						
Distribution	$	17 894	$	1 730		S/O
Actions émises en circulation		2 069		174		S/O
VNI par action	$	8,65	$	9,92		S/O
Catégorie E en AUD (couverte) :						
Distribution	AUD	2 119	AUD	365		S/O
Actions émises en circulation		249		37		S/O
VNI par action	AUD	8,52	AUD	9,90		S/O
Catégorie E en EUR (couverte) :						
Distribution	€	3 221	€	494		S/O
Actions émises en circulation		385		50		S/O
VNI par action	€	8,37	€	9,85		S/O
Catégorie E en GBP (couverte) :						
Distribution	£	2 810	£	196		S/O
Actions émises en circulation		329		20		S/O
VNI par action	£	8,55	£	9,90		S/O
Catégorie E en HKD (non couverte) :						
Distribution	HKD	62 867	HKD	2 462		S/O
Actions émises en circulation		7 226		247		S/O
VNI par action	HKD	8,70	HKD	9,98		S/O
Catégorie E en SGD (couverte) :						
Distribution		S/O	SGD	333		S/O
Actions émises en circulation		S/O		34		S/O
VNI par action		S/O	SGD	9,93		S/O
Fonds Inflation Multi-Asset Fund						
Actif net	$	403 078	$	164 345	$	70 032
Institutions :						
Capitalisation	$	83 455	$	68 012	$	55 509
Actions émises en circulation		7 503		5 798		5 263
VNI par action	$	11,12	$	11,73	$	10,55
Institutions en EUR (partiellement couverte) :						
Capitalisation	€	82 243	€	4 749		S/O
Actions émises en circulation		8 718		477		S/O
VNI par action	€	9,43	€	9,96		S/O
Institutions en GBP (partiellement couverte) :						
Capitalisation	£	3 543	£	22 843	£	2 213
Actions émises en circulation		308		1 924		207
VNI par action	£	11,50	£	11,87	£	10,68

	Au 31 décembre 2022		Au 31 décembre 2021		Au 31 décembre 2020	
Fonds Inflation Multi-Asset Fund (suite)						
Administrations :						
Distribution II	$	2 961		S/O		S/O
Actions émises en circulation		338		S/O		S/O
VNI par action	$	8,75		S/O		S/O
Administrations en SGD (couverte) :						
Distribution II	SGD	10 723		S/O		S/O
Actions émises en circulation		1 197		S/O		S/O
VNI par action	SGD	8,95		S/O		S/O
Catégorie E :						
Capitalisation	$	85 842	$	14 809	$	2 620
Actions émises en circulation		8 673		1 405		273
VNI par action	$	9,90	$	10,54	$	9,59
Distribution II	$	9		S/O		S/O
Actions émises en circulation		1		S/O		S/O
VNI par action	$	9,27		S/O		S/O
Catégorie E en AUD (partiellement couverte) :						
Capitalisation	AUD	334		S/O		S/O
Actions émises en circulation		36		S/O		S/O
VNI par action	AUD	9,35		S/O		S/O
Catégorie E en EUR (partiellement couverte) :						
Capitalisation	€	110 990	€	33 996	€	6 072
Actions émises en circulation		11 966		3 436		683
VNI par action	€	9,28	€	9,89	€	8,89
Distribution	€	11 302	€	5 738	€	1 185
Actions émises en circulation		1 312		608		137
VNI par action	€	8,61	€	9,43	€	8,62
Catégorie E en GBP (partiellement couverte) :						
Capitalisation	£	8		S/O		S/O
Actions émises en circulation		1		S/O		S/O
VNI par action	£	9,41		S/O		S/O
Catégorie E en SGD (partiellement couverte) :						
Capitalisation	SGD	13		S/O		S/O
Actions émises en circulation		1		S/O		S/O
VNI par action	SGD	9,35		S/O		S/O
H Institutions :						
Capitalisation	$	9		S/O		S/O
Actions émises en circulation		1		S/O		S/O
VNI par action	$	9,45		S/O		S/O
M Détail :						
Distribution II	$	9		S/O		S/O
Actions émises en circulation		1		S/O		S/O
VNI par action	$	9,32		S/O		S/O
Fonds Low Average Duration Fund						
Actif net	$	1 072 758	$	1 179 138	$	1 183 413
Institutions :						
Capitalisation	$	640 710	$	747 732	$	806 772
Actions émises en circulation		41 077		45 606		48 799
VNI par action	$	15,60	$	16,40	$	16,53
Distribution	$	53 185	$	33 312	$	37 437
Actions émises en circulation		5 377		3 159		3 500
VNI par action	$	9,89	$	10,54	$	10,70
Institutions en EUR (couverte) :						
Capitalisation	€	37 536	€	35 456	€	35 471
Actions émises en circulation		3 864		3 402		3 347
VNI par action	€	9,71	€	10,42	€	10,60
Distribution	€	8 986	€	10 023	€	8 988
Actions émises en circulation		1 270		1 302		1 141
VNI par action	€	7,08	€	7,70	€	7,88
Institutions en GBP (couverte) :						
Capitalisation	£	17 044	£	13 877	£	6 460
Actions émises en circulation		1 748		1 347		621
VNI par action	£	9,75	£	10,30	£	10,40

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds Low Average Duration Fund (suite)			
Distribution	£ 3 285	£ 4 225	£ 11 174
Actions émises en circulation	367	439	1 141
VNI par action	£ 8,95	£ 9,64	£ 9,79
Investisseurs :			
Capitalisation	$ 16 532	$ 20 960	$ 30 355
Actions émises en circulation	1 131	1 359	1 945
VNI par action	$ 14,62	$ 15,42	$ 15,61
Distribution	$ 2 022	$ 7 973	$ 9 569
Actions émises en circulation	206	762	902
VNI par action	$ 9,81	$ 10,46	$ 10,61
Administrations :			
Capitalisation	$ 10 755	$ 11 016	$ 15 464
Actions émises en circulation	755	733	1 014
VNI par action	$ 14,24	$ 15,04	$ 15,24
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 47 980	$ 52 498	$ 81 937
Actions émises en circulation	3 979	4 104	6 297
VNI par action	$ 12,06	$ 12,79	$ 13,01
Distribution	$ 5 384	$ 6 751	$ 13 842
Actions émises en circulation	528	621	1 251
VNI par action	$ 10,20	$ 10,87	$ 11,06
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 25 480	€ 18 812	€ 19 638
Actions émises en circulation	3 238	2 209	2 247
VNI par action	€ 7,87	€ 8,52	€ 8,74
H Institutions :			
Capitalisation	$ 186 190	$ 186 367	$ 72 717
Actions émises en circulation	15 891	15 108	5 837
VNI par action	$ 11,72	$ 12,34	$ 12,46
Distribution	$ 1 521	$ 7 574	$ 6 978
Actions émises en circulation	159	745	677
VNI par action	$ 9,54	$ 10,16	$ 10,31
Catégorie R :			
Capitalisation	$ 7 183	$ 7 325	$ 5 812
Actions émises en circulation	687	665	522
VNI par action	$ 10,45	$ 11,02	$ 11,14
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund			
Actif net	$ 654 749	$ 806 869	$ 632 519
Institutions :			
Capitalisation	$ 120 881	$ 94 445	$ 92 260
Actions émises en circulation	10 562	7 805	7 572
VNI par action	$ 11,44	$ 12,10	$ 12,18
Distribution	$ 17 001	$ 10	S/O
Actions émises en circulation	1 859	1	S/O
VNI par action	$ 9,15	$ 9,82	S/O
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 417 993	€ 520 319	€ 358 476
Actions émises en circulation	41 937	48 370	32 815
VNI par action	€ 9,97	€ 10,76	€ 10,92
Distribution	€ 133	€ 928	S/O
Actions émises en circulation	15	95	S/O
VNI par action	€ 8,90	€ 9,75	S/O
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 18 388	£ 18 462	£ 20 287
Actions émises en circulation	1 708	1 611	1 754
VNI par action	£ 10,77	£ 11,46	£ 11,57
Distribution	£ 3 910	£ 18 096	S/O
Actions émises en circulation	432	1 849	S/O
VNI par action	£ 9,06	£ 9,79	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund (suite)			
Institutions en NOK (couverte) :			
Capitalisation	NOK 159 169	NOK 441 039	NOK 416 606
Actions émises en circulation	1 581	4 119	3 864
VNI par action	NOK 100,63	NOK 107,06	NOK 107,82
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 25 901	€ 17 694	€ 20 641
Actions émises en circulation	2 816	1 767	2 011
VNI par action	€ 9,20	€ 10,01	€ 10,26
Fonds Low Duration Income Fund			
Actif net	$ 1 084 380	$ 1 367 475	$ 960 639
Institutions :			
Capitalisation	$ 186 357	$ 275 963	$ 6 730
Actions émises en circulation	17 111	24 381	607
VNI par action	$ 10,89	$ 11,32	$ 11,08
Distribution	$ 11 734	$ 13 398	$ 2 025
Actions émises en circulation	1 229	1 305	196
VNI par action	$ 9,56	$ 10,27	$ 10,31
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	S/O	CHF 1 854	CHF 401
Actions émises en circulation	S/O	178	39
VNI par action	S/O	CHF 10,43	CHF 10,32
Distribution	S/O	S/O	CHF 10
Actions émises en circulation	S/O	S/O	1
VNI par action	S/O	S/O	CHF 9,58
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 633 070	€ 666 067	€ 605 043
Actions émises en circulation	63 769	63 153	58 084
VNI par action	€ 9,93	€ 10,55	€ 10,42
Distribution	€ 8	€ 60 301	S/O
Actions émises en circulation	1	6 036	S/O
VNI par action	€ 9,14	€ 9,99	S/O
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 3 280	£ 5 158	£ 150 468
Actions émises en circulation	316	475	14 121
VNI par action	£ 10,37	£ 10,85	£ 10,66
Distribution	£ 50 073	£ 130 935	£ 8
Actions émises en circulation	5 539	13 372	1
VNI par action	£ 9,04	£ 9,79	£ 9,86
Institutions en SGD (couverte) :			
Capitalisation	SGD 15 840	SGD 19 822	SGD 589
Actions émises en circulation	1 566	1 883	57
VNI par action	SGD 10,12	SGD 10,53	SGD 10,30
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	S/O	€ 639	€ 9
Actions émises en circulation	S/O	61	1
VNI par action	S/O	€ 10,41	€ 10,32
Distribution	S/O	€ 452	€ 9
Actions émises en circulation	S/O	48	1
VNI par action	S/O	€ 9,46	€ 9,62
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 27 537	$ 16 491	$ 1 386
Actions émises en circulation	2 629	1 502	128
VNI par action	$ 10,47	$ 10,98	$ 10,85
Distribution	$ 8 193	$ 9 075	$ 1 034
Actions émises en circulation	885	904	102
VNI par action	$ 9,25	$ 10,04	$ 10,17
Catégorie E en CHF (couverte) :			
Capitalisation	S/O	S/O	CHF 10
Actions émises en circulation	S/O	S/O	1
VNI par action	S/O	S/O	CHF 10,10

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds Low Duration Income Fund (suite)			
Distribution	S/O	S/O	CHF 10
Actions émises en circulation	S/O	S/O	1
VNI par action	S/O	S/O	CHF 9,46
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 31 442	€ 16 611	€ 1 334
Actions émises en circulation	3 297	1 625	131
VNI par action	€ 9,54	€ 10,22	€ 10,18
Distribution	€ 2 708	€ 1 014	€ 265
Actions émises en circulation	322	109	28
VNI par action	€ 8,42	€ 9,34	€ 9,55
Catégorie E en SGD (couverte) :			
Distribution	S/O	SGD 721	SGD 712
Actions émises en circulation	S/O	73	71
VNI par action	S/O	SGD 9,90	SGD 10,02
H Institutions :			
Capitalisation	$ 62 043	$ 3 622	$ 10
Actions émises en circulation	6 136	344	1
VNI par action	$ 10,11	$ 10,53	$ 10,33
Distribution	$ 418	S/O	S/O
Actions émises en circulation	45	S/O	S/O
VNI par action	$ 9,34	S/O	S/O
Catégorie Z en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 9	€ 10	€ 10
Actions émises en circulation	1	1	1
VNI par action	€ 10,21	€ 10,79	€ 10,59
Fonds Low Duration Opportunities Fund			
Actif net	$ 1 345 781	$ 3 217 260	$ 2 644 601
Institutions :			
Capitalisation	$ 61 036	$ 142 348	$ 96 148
Actions émises en circulation	5 569	12 027	8 110
VNI par action	$ 10,96	$ 11,84	$ 11,86
Distribution	$ 33 224	$ 41 508	$ 8 606
Actions émises en circulation	3 555	4 051	830
VNI par action	$ 9,35	$ 10,25	$ 10,37
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 23 753	€ 41 652	€ 54 549
Actions émises en circulation	2 478	3 940	5 108
VNI par action	€ 9,58	€ 10,57	€ 10,68
Distribution	€ 10 599	€ 12 374	€ 27 239
Actions émises en circulation	1 244	1 297	2 796
VNI par action	€ 8,52	€ 9,54	€ 9,74
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 713 035	£ 1 734 093	£ 1 417 923
Actions émises en circulation	69 498	155 485	126 639
VNI par action	£ 10,26	£ 11,15	£ 11,20
Distribution	£ 288 970	£ 447 455	£ 352 374
Actions émises en circulation	31 985	44 752	34 734
VNI par action	£ 9,03	£ 10,00	£ 10,14
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 4 406	€ 8 109	€ 10 572
Actions émises en circulation	485	806	1 036
VNI par action	€ 9,09	€ 10,06	€ 10,20
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 3 102	€ 4 360	€ 5 666
Actions émises en circulation	350	443	566
VNI par action	€ 8,86	€ 9,84	€ 10,01
Catégorie Z :			
Capitalisation	$ 1 534	$ 2 989	S/O
Actions émises en circulation	166	301	S/O
VNI par action	$ 9,24	$ 9,93	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund			
Actif net	$ 4 928	S/O	S/O
Institutions :			
Capitalisation	$ 4 426	S/O	S/O
Actions émises en circulation	446	S/O	S/O
VNI par action	$ 9,90	S/O	S/O
Distribution	$ 10	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	$ 9,81	S/O	S/O
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 225	S/O	S/O
Actions émises en circulation	23	S/O	S/O
VNI par action	€ 9,78	S/O	S/O
Distribution	€ 9	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	€ 9,69	S/O	S/O
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 194	S/O	S/O
Actions émises en circulation	20	S/O	S/O
VNI par action	£ 9,85	S/O	S/O
Distribution	£ 8	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	£ 9,75	S/O	S/O
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund			
Actif net	$ 120 137	$ 100 538	$ 77 631
Institutions :			
Capitalisation	$ 21 492	$ 21 487	$ 22 753
Actions émises en circulation	2 114	2 658	4 069
VNI par action	$ 10,17	$ 8,08	$ 5,59
Distribution	$ 10 469	$ 29 680	$ 30 040
Actions émises en circulation	1 678	5 697	7 885
VNI par action	$ 6,24	$ 5,21	$ 3,81
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 41 892	€ 19 141	€ 7 987
Actions émises en circulation	4 844	2 714	1 623
VNI par action	€ 8,65	€ 7,05	€ 4,92
Distribution	€ 3 309	€ 2 062	€ 1 546
Actions émises en circulation	625	455	461
VNI par action	€ 5,29	€ 4,54	€ 3,36
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 1 415	£ 1 362	£ 961
Actions émises en circulation	162	193	195
VNI par action	£ 8,76	£ 7,07	£ 4,93
Distribution	S/O	£ 25	£ 101
Actions émises en circulation	S/O	5	30
VNI par action	S/O	£ 4,51	£ 3,34
Investisseurs :			
Capitalisation	S/O	$ 1 183	$ 1 179
Actions émises en circulation	S/O	117	168
VNI par action	S/O	$ 10,09	$ 7,00
Distribution	S/O	S/O	$ 7
Actions émises en circulation	S/O	S/O	1
VNI par action	S/O	S/O	$ 5,76
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	S/O	S/O	€ 24
Actions émises en circulation	S/O	S/O	4
VNI par action	S/O	S/O	€ 6,55
Catégorie E :			
Distribution	$ 23 893	$ 10 905	$ 4 830
Actions émises en circulation	4 223	2 287	1 368
VNI par action	$ 5,66	$ 4,77	$ 3,53

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund (suite)			
Catégorie Z :			
Capitalisation	$ 14 340	$ 11 293	$ 5 677
Actions émises en circulation	1 113	1 113	818
VNI par action	$ 12,88	$ 10,14	$ 6,94
Fonds Mortgage Opportunities Fund			
Actif net	$ 849 148	$ 2 238 424	$ 1 977 007
Institutions :			
Capitalisation	$ 409 011	$ 558 563	$ 491 609
Actions émises en circulation	38 104	47 581	42 776
VNI par action	$ 10,73	$ 11,74	$ 11,49
Distribution	$ 94 373	$ 351 769	$ 285 533
Actions émises en circulation	10 759	35 231	28 386
VNI par action	$ 8,77	$ 9,98	$ 10,06
Institutions en CAD (couverte) :			
Capitalisation	CAD 23 438	CAD 25 659	S/O
Actions émises en circulation	2 532	2 532	S/O
VNI par action	CAD 9,26	CAD 10,14	S/O
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 3 010	CHF 5 577	CHF 6 951
Actions émises en circulation	322	532	670
VNI par action	CHF 9,34	CHF 10,47	CHF 10,37
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 192 977	€ 317 357	€ 330 507
Actions émises en circulation	20 209	29 769	31 397
VNI par action	€ 9,55	€ 10,66	€ 10,53
Distribution	€ 14 970	€ 26 722	€ 9 571
Actions émises en circulation	1 923	2 953	1 041
VNI par action	€ 7,78	€ 9,05	€ 9,20
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 7 355	£ 19 288	£ 7 971
Actions émises en circulation	727	1 733	730
VNI par action	£ 10,12	£ 11,13	£ 10,92
Distribution	£ 6 104	£ 5 764	£ 11 380
Actions émises en circulation	740	609	1 192
VNI par action	£ 8,25	£ 9,46	£ 9,55
Investisseurs :			
Capitalisation	$ 20 219	$ 32 611	$ 49 987
Actions émises en circulation	1 963	2 885	4 499
VNI par action	$ 10,30	$ 11,30	$ 11,11
Distribution	$ 4 762	$ 19 104	$ 12 072
Actions émises en circulation	543	1 914	1 200
VNI par action	$ 8,77	$ 9,98	$ 10,06
Administrations :			
Distribution	$ 44	$ 540	$ 544
Actions émises en circulation	5	54	54
VNI par action	$ 8,77	$ 9,98	$ 10,06
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 43 823	$ 58 797	$ 65 293
Actions émises en circulation	4 304	5 232	5 878
VNI par action	$ 10,18	$ 11,24	$ 11,11
Distribution	$ 4 351	$ 10 154	$ 10 765
Actions émises en circulation	496	1 017	1 070
VNI par action	$ 8,77	$ 9,99	$ 10,06
Catégorie E en CHF (couverte) :			
Distribution	CHF 166	CHF 319	CHF 338
Actions émises en circulation	22	36	38
VNI par action	CHF 7,55	CHF 8,82	CHF 8,98
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 12 803	€ 16 220	€ 18 176
Actions émises en circulation	1 415	1 591	1 788
VNI par action	€ 9,05	€ 10,20	€ 10,16

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds Mortgage Opportunities Fund (suite)			
Distribution	S/O	€ 151	€ 131
Actions émises en circulation	S/O	17	14
VNI par action	S/O	€ 8,98	€ 9,13
Catégorie E en SGD (couverte) :			
Capitalisation	S/O	S/O	SGD 15
Actions émises en circulation	S/O	S/O	1
VNI par action	S/O	S/O	SGD 10,63
Distribution	S/O	SGD 1 645	SGD 2 135
Actions émises en circulation	S/O	168	217
VNI par action	S/O	SGD 9,78	SGD 9,85
H Institutions :			
Capitalisation	$ 39	$ 71	$ 11
Actions émises en circulation	4	7	1
VNI par action	$ 9,88	$ 10,83	$ 10,62
Catégorie Z :			
Capitalisation	$ 10	$ 214 716	$ 74 635
Actions émises en circulation	1	19 628	7 012,00
VNI par action	$ 9,78	$ 10,94	$ 10,64
Catégorie Z en GBP (couverte) :			
Capitalisation	S/O	£ 384 109	£ 374 361
Actions émises en circulation	S/O	34 658	34 658
VNI par action	S/O	£ 11,08	£ 10,80
Fonds StocksPLUS™ Fund			
Actif net	$ 1 008 739	$ 3 761 156	$ 3 538 833
Institutions :			
Capitalisation	$ 581 668	$ 2 349 757	$ 2 530 233
Actions émises en circulation	12 422	39 164	53 956
VNI par action	$ 46,83	$ 60,00	$ 46,89
Distribution	$ 24 829	$ 39 901	$ 45 032
Actions émises en circulation	734	913	1 319
VNI par action	$ 33,81	$ 43,69	$ 34,14
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 131 649	€ 570 050	€ 530 048
Actions émises en circulation	4 953	16 237	19 143
VNI par action	€ 26,58	€ 35,11	€ 27,69
Distribution	S/O	€ 2 081	€ 1 636
Actions émises en circulation	S/O	68	68
VNI par action	S/O	€ 30,66	€ 24,18
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 3 922	£ 199	S/O
Actions émises en circulation	456	18	S/O
VNI par action	£ 8,60	£ 11,28	S/O
Institutions en SGD (couverte) :			
Capitalisation	SGD 335	S/O	S/O
Actions émises en circulation	38	S/O	S/O
VNI par action	SGD 8,76	S/O	S/O
Investisseurs :			
Capitalisation	$ 19 778	$ 21 609	$ 18 615
Actions émises en circulation	458	389	428
VNI par action	$ 43,17	$ 55,51	$ 43,53
BE Détail :			
Capitalisation	$ 9	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	$ 8,66	S/O	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 165 517	$ 175 651	$ 91 242
Actions émises en circulation	4 087	3 355	2 210
VNI par action	$ 40,50	$ 52,35	$ 41,29
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 35 366	€ 13 927	€ 9 527
Actions émises en circulation	2 632	777	668
VNI par action	€ 13,44	€ 17,91	€ 14,25

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds StocksPLUS™ Fund (suite)			
H Institutions :			
Capitalisation	$ 33 724	$ 504 831	$ 189 133
Actions émises en circulation	2 884	33 635	16 101
VNI par action	$ 11,69	$ 15,01	$ 11,75
Catégorie T :			
Capitalisation	S/O	$ 2 673	$ 2 380
Actions émises en circulation	S/O	124	140
VNI par action	S/O	$ 21,50	$ 17,03
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund			
Actif net	$ 9 528	$ 11 610	$ 8 417
Institutions :			
Capitalisation	$ 9 327	$ 10 848	$ 8 021
Actions émises en circulation	663	603	570
VNI par action	$ 14,07	$ 17,97	$ 14,09
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	S/O	€ 405	€ 312
Actions émises en circulation	S/O	24	23
VNI par action	S/O	€ 17,09	€ 13,52
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 167	£ 198	S/O
Actions émises en circulation	19	18	S/O
VNI par action	£ 8,59	£ 11,24	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	S/O	$ 34	$ 14
Actions émises en circulation	S/O	2	1
VNI par action	S/O	$ 17,53	$ 13,87
Fonds Strategic Income Fund			
Actif net	$ 506 557	$ 619 928	$ 974 664
Institutions :			
Capitalisation	$ 21 761	$ 33 080	$ 35 112
Actions émises en circulation	1 939	2 754	3 118
VNI par action	$ 11,22	$ 12,01	$ 11,26
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 168 023	€ 207 426	€ 453 622
Actions émises en circulation	13 134	14 906	34 652
VNI par action	€ 12,79	€ 13,92	€ 13,09
Institutions en GBP (couverte) :			
Distribution	£ 201	S/O	S/O
Actions émises en circulation	21	S/O	S/O
VNI par action	£ 9,67	S/O	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 37 001	$ 35 991	$ 33 128
Actions émises en circulation	2 786	2 509	2 441
VNI par action	$ 13,28	$ 14,34	$ 13,57
Distribution II	$ 18 150	$ 18 959	$ 18 919
Actions émises en circulation	1 989	1 828	1 848
VNI par action	$ 9,13	$ 10,37	$ 10,24
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 133 817	€ 140 034	€ 143 937
Actions émises en circulation	11 367	10 837	11 731
VNI par action	€ 11,77	€ 12,92	€ 12,27
Distribution II	€ 76 984	€ 94 373	€ 102 667
Actions émises en circulation	9 528	10 105	11 093
VNI par action	€ 8,08	€ 9,34	€ 9,25
Catégorie T en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 15 503	€ 17 708	€ 17 321
Actions émises en circulation	1 475	1 529	1 569
VNI par action	€ 10,51	€ 11,58	€ 11,04
Distribution	€ 8 019	€ 8 185	€ 7 803
Actions émises en circulation	908	817	800
VNI par action	€ 8,83	€ 10,02	€ 9,76

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds Total Return Bond Fund			
Actif net	$ 4 150 717	$ 4 944 898	$ 6 424 053
Institutions :			
Capitalisation	$ 1 419 973	$ 1 598 195	$ 1 930 542
Actions émises en circulation	49 161	46 882	55 944
VNI par action	$ 28,88	$ 34,09	$ 34,51
Distribution	$ 112 085	$ 174 533	$ 187 163
Actions émises en circulation	7 634	9 829	10 216
VNI par action	$ 14,68	$ 17,76	$ 18,32
Institutions en CAD (couverte) :			
Distribution	CAD 13 555	CAD 26 323	CAD 26 735
Actions émises en circulation	1 587	2 540	2 497
VNI par action	CAD 8,54	CAD 10,36	CAD 10,70
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 3 138	CHF 13 206	CHF 16 880
Actions émises en circulation	320	1 111	1 388
VNI par action	CHF 9,79	CHF 11,88	CHF 12,16
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 388 231	€ 358 693	€ 495 828
Actions émises en circulation	20 056	15 344	20 771
VNI par action	€ 19,36	€ 23,38	€ 23,87
Distribution	€ 212 408	€ 260 110	€ 216 306
Actions émises en circulation	18 120	17 931	14 322
VNI par action	€ 11,72	€ 14,51	€ 15,10
Institutions en EUR (non couverte) :			
Capitalisation	€ 19 929	€ 14 618	€ 33 888
Actions émises en circulation	736	488	1 202
VNI par action	€ 27,06	€ 29,97	€ 28,20
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 3 621	£ 5 534	£ 9 730
Actions émises en circulation	296	379	658
VNI par action	£ 12,24	£ 14,59	£ 14,80
Distribution	£ 29 067	£ 43 763	£ 39 302
Actions émises en circulation	3 543	4 355	3 783
VNI par action	£ 8,20	£ 10,05	£ 10,39
Institutions en ILS (couverte) :			
Capitalisation	S/O	ILS 185	ILS 578
Actions émises en circulation	S/O	13	39
VNI par action	S/O	ILS 14,41	ILS 14,67
Institutions en SGD (couverte) :			
Capitalisation	SGD 7 941	SGD 21 940	SGD 19 222
Actions émises en circulation	652	1 524	1 320
VNI par action	SGD 12,17	SGD 14,40	SGD 14,57
Investisseurs :			
Capitalisation	$ 409 533	$ 369 122	$ 573 009
Actions émises en circulation	15 440	11 750	17 957
VNI par action	$ 26,52	$ 31,41	$ 31,91
Distribution	$ 67 693	$ 35 775	$ 129 625
Actions émises en circulation	4 545	1 987	6 977
VNI par action	$ 14,89	$ 18,01	$ 18,58
Investisseurs en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 2 893	CHF 4 784	CHF 6 265
Actions émises en circulation	307	417	532
VNI par action	CHF 9,41	CHF 11,46	CHF 11,77

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds Total Return Bond Fund (suite)			
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 18 868	€ 19 262	€ 27 120
Actions émises en circulation	1 038	874	1 201
VNI par action	€ 18,18	€ 22,03	€ 22,58
Administrations :			
Capitalisation	$ 130 283	$ 159 690	$ 188 750
Actions émises en circulation	4 975	5 141	5 973
VNI par action	$ 26,19	$ 31,06	$ 31,60
Distribution	$ 4 583	S/O	S/O
Actions émises en circulation	482	S/O	S/O
VNI par action	$ 9,51	S/O	S/O
Administrations en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 2 966	€ 1 953	€ 3 742
Actions émises en circulation	273	148	277
VNI par action	€ 10,84	€ 13,16	€ 13,51
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 380 803	$ 478 210	$ 676 175
Actions émises en circulation	15 332	16 167	22 380
VNI par action	$ 24,84	$ 29,58	$ 30,21
Distribution	$ 151 164	$ 199 962	$ 243 049
Actions émises en circulation	13 526	14 801	17 436
VNI par action	$ 11,18	$ 13,51	$ 13,94
Catégorie E en CHF (couverte) :			
Capitalisation	CHF 9 731	CHF 5 648	CHF 6 592
Actions émises en circulation	1 166	553	625
VNI par action	CHF 8,34	CHF 10,22	CHF 10,55
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 471 035	€ 623 265	€ 833 038
Actions émises en circulation	28 276	30 705	39 827
VNI par action	€ 16,66	€ 20,30	€ 20,92
Distribution	€ 40 476	€ 54 687	€ 74 430
Actions émises en circulation	5 177	5 655	7 393
VNI par action	€ 7,82	€ 9,67	€ 10,07
Catégorie E en EUR (non couverte) :			
Capitalisation	€ 489	€ 710	S/O
Actions émises en circulation	51	67	S/O
VNI par action	€ 9,53	€ 10,65	S/O
Catégorie E en HKD (non couverte) :			
Capitalisation	HKD 1 568	HKD 3 128	HKD 2 773
Actions émises en circulation	155	259	226
VNI par action	HKD 10,15	HKD 12,07	HKD 12,26
Catégorie E en SGD (couverte) :			
Capitalisation	SGD 30 035	SGD 38 699	SGD 42 772
Actions émises en circulation	828	894	968
VNI par action	SGD 36,28	SGD 43,30	SGD 44,20
H Institutions :			
Capitalisation	$ 115 199	$ 199 555	$ 205 400
Actions émises en circulation	4 116	6 033	6 124
VNI par action	$ 27,98	$ 33,08	$ 33,54
Distribution	$ 8 589	$ 17 255	$ 15 468
Actions émises en circulation	954	1 585	1 377
VNI par action	$ 9,00	$ 10,89	$ 11,23
M Détail en HKD (non couverte) :			
Distribution	HKD 76 242	HKD 91 252	HKD 96 768
Actions émises en circulation	8 622	8 552	8 838
VNI par action	HKD 8,84	HKD 10,67	HKD 10,95
Catégorie R en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 2 836	€ 5 974	€ 5 521
Actions émises en circulation	308	535	483
VNI par action	€ 9,22	€ 11,16	€ 11,43

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds Total Return Bond Fund (suite)			
Catégorie T :			
Capitalisation	$ 6 382	$ 13 697	$ 18 261
Actions émises en circulation	652	1 172	1 525
VNI par action	$ 9,79	$ 11,69	$ 11,97
Catégorie T en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 4 426	€ 4 561	€ 6 041
Actions émises en circulation	518	437	560
VNI par action	€ 8,54	€ 10,44	€ 10,79
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund			
Actif net	$ 435 924	$ 101 789	$ 47 221
Institutions :			
Capitalisation	$ 183 555	$ 70 982	$ 24 193
Actions émises en circulation	14 361	6 152	2 142
VNI par action	$ 12,78	$ 11,54	$ 11,30
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 121 520	€ 11 436	€ 12 591
Actions émises en circulation	10 765	1 108	1 236
VNI par action	€ 11,29	€ 10,32	€ 10,19
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 9	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	£ 9,88	S/O	S/O
Distribution	£ 31 132	S/O	S/O
Actions émises en circulation	3 333	S/O	S/O
VNI par action	£ 9,34	S/O	S/O
Investisseurs :			
Capitalisation	$ 9	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	$ 9,43	S/O	S/O
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 9	S/O	S/O
Actions émises en circulation	1	S/O	S/O
VNI par action	€ 9,39	S/O	S/O
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 11 079	$ 2 886	$ 6 232
Actions émises en circulation	941	269	586
VNI par action	$ 11,78	$ 10,74	$ 10,63
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 17 465	€ 1 747	€ 1 136
Actions émises en circulation	1 680	182	118
VNI par action	€ 10,40	€ 9,61	€ 9,60
H Institutions :			
Capitalisation	$ 43	S/O	S/O
Actions émises en circulation	4	S/O	S/O
VNI par action	$ 10,13	S/O	S/O
Catégorie Z :			
Capitalisation	$ 55 435	$ 12 929	S/O
Actions émises en circulation	4 958	1 299	S/O
VNI par action	$ 11,18	$ 9,95	S/O
Fonds UK Corporate Bond Fund			
Actif net	£ 389 173	£ 592 164	£ 764 359
Institutions :			
Capitalisation	£ 46 355	£ 75 231	£ 139 232
Actions émises en circulation	2 532	3 348	6 000
VNI par action	£ 18,31	£ 22,47	£ 23,20
Distribution	£ 276 939	£ 436 466	£ 542 403
Actions émises en circulation	32 956	41 393	49 002
VNI par action	£ 8,40	£ 10,54	£ 11,07

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds UK Corporate Bond Fund (suite)			
H Institutions :			
Distribution	S/O	S/O	£ 9
Actions émises en circulation	S/O	S/O	1
VNI par action	S/O	S/O	£ 10,28
Catégorie Z :			
Capitalisation	£ 65 879	£ 80 467	£ 82 715
Actions émises en circulation	7 715	7 715	7 715
VNI par action	£ 8,54	£ 10,43	£ 10,72
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund			
Actif net	£ 325 020	£ 425 748	£ 364 631
Institutions :			
Capitalisation	£ 283 958	£ 366 869	£ 300 422
Actions émises en circulation	14 455	13 155	10 335
VNI par action	£ 19,65	£ 27,89	£ 29,07
Distribution	£ 41 062	£ 58 879	£ 64 209
Actions émises en circulation	3 656	3 578	3 656
VNI par action	£ 11,23	£ 16,45	£ 17,56
Fonds US High Yield Bond Fund			
Actif net	$ 1 984 922	$ 3 923 786	$ 4 054 927
Institutions :			
Capitalisation	$ 780 024	$ 1 665 090	$ 2 254 396
Actions émises en circulation	21 785	40 803	57 680
VNI par action	$ 35,80	$ 40,81	$ 39,09
Distribution	$ 233 780	$ 400 716	$ 319 414
Actions émises en circulation	27 877	39 668	31 532
VNI par action	$ 8,39	$ 10,10	$ 10,13
Institutions en CHF (couverte) :			
Capitalisation	S/O	CHF 2 738	CHF 2 604
Actions émises en circulation	S/O	222	218
VNI par action	S/O	CHF 12,33	CHF 11,94
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 240 268	€ 482 095	€ 297 614
Actions émises en circulation	8 811	15 170	9 695
VNI par action	€ 27,27	€ 31,78	€ 30,70
Distribution	€ 33 678	€ 138 522	€ 126 166
Actions émises en circulation	3 520	11 751	10 575
VNI par action	€ 9,57	€ 11,79	€ 11,93
Institutions en GBP (couverte) :			
Capitalisation	£ 40 143	£ 48 533	£ 41 967
Actions émises en circulation	1 913	2 009	1 809
VNI par action	£ 20,99	£ 24,16	£ 23,20
Distribution	£ 1 108	£ 5 115	£ 7 216
Actions émises en circulation	138	522	731
VNI par action	£ 8,04	£ 9,80	£ 9,86
Institutions en SGD (couverte) :			
Capitalisation	S/O	SGD 374	S/O
Actions émises en circulation	S/O	37	S/O
VNI par action	S/O	SGD 10,10	S/O
Investisseurs :			
Capitalisation	$ 236 934	$ 434 782	$ 307 813
Actions émises en circulation	7 413	11 894	8 760
VNI par action	$ 31,96	$ 36,56	$ 35,14
Distribution	$ 20 862	$ 37 431	$ 31 926
Actions émises en circulation	3 073	4 581	3 897
VNI par action	$ 6,79	$ 8,17	$ 8,19
Investisseurs en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 2 708	€ 3 173	€ 3 819
Actions émises en circulation	110	110	137
VNI par action	€ 24,59	€ 28,78	€ 27,89

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
Fonds US High Yield Bond Fund (suite)			
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 132 559	$ 225 933	$ 203 678
Actions émises en circulation	4 302	6 375	5 947
VNI par action	$ 30,82	$ 35,44	$ 34,25
Distribution	$ 58 679	$ 124 742	$ 103 491
Actions émises en circulation	6 557	11 581	9 577
VNI par action	$ 8,95	$ 10,77	$ 10,81
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 56 406	€ 77 393	€ 84 948
Actions émises en circulation	2 407	2 808	3 162
VNI par action	€ 23,44	€ 27,56	€ 26,86
H Institutions :			
Capitalisation	$ 88 253	$ 139 658	$ 112 228
Actions émises en circulation	2 548	3 532	2 958
VNI par action	$ 34,63	$ 39,54	$ 37,94
Distribution	$ 2 482	$ 3 370	$ 2 484
Actions émises en circulation	299	337	248
VNI par action	$ 8,29	$ 9,99	$ 10,01
M Détail :			
Distribution	$ 12 265	$ 4 154	$ 8 103
Actions émises en circulation	1 351	381	740
VNI par action	$ 9,08	$ 10,91	$ 10,95
Catégorie R :			
Capitalisation	$ 5 477	$ 4 914	$ 4 885
Actions émises en circulation	387	304	314
VNI par action	$ 14,17	$ 16,18	$ 15,54
Catégorie Z :			
Capitalisation	$ 8 528	$ 9 666	$ 9 208
Actions émises en circulation	661	661	661
VNI par action	$ 12,91	$ 14,63	$ 13,93
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund			
Actif net	$ 388 522	$ 878 100	$ 1 180 148
Institutions :			
Capitalisation	$ 151 061	$ 132 646	$ 247 764
Actions émises en circulation	14 307	10 461	19 215
VNI par action	$ 10,56	$ 12,68	$ 12,89
Distribution	$ 61 577	$ 63 781	$ 93 048
Actions émises en circulation	7 201	5 999	8 352
VNI par action	$ 8,55	$ 10,63	$ 11,14
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 124 155	€ 214 560	€ 276 920
Actions émises en circulation	13 447	18 908	23 784
VNI par action	€ 9,23	€ 11,35	€ 11,64
Institutions en GBP (couverte) :			
Distribution II	£ 13 692	£ 304 200	£ 336 589
Actions émises en circulation	1 794	31 489	33 002
VNI par action	£ 7,63	£ 9,66	£ 10,20
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 21 852	$ 17 627	$ 27 163
Actions émises en circulation	2 504	1 667	2 503
VNI par action	$ 8,73	$ 10,58	$ 10,85
Distribution	$ 5 002	$ 8 025	$ 13 248
Actions émises en circulation	576	743	1 170
VNI par action	$ 8,68	$ 10,80	$ 11,32
H Institutions :			
Capitalisation	$ 55	S/O	S/O
Actions émises en circulation	6	S/O	S/O
VNI par action	$ 9,73	S/O	S/O

	Au 31 décembre 2022	Au 31 décembre 2021	Au 31 décembre 2020
	Fonds US Short-Term Fund		
Actif net	$ 2 310 115	$ 2 650 198	$ 3 654 185
Institutions :			
Capitalisation	$ 865 421	$ 835 096	$ 1 571 393
Actions émises en circulation	76 197	73 558	138 207
VNI par action	$ 11,36	$ 11,35	$ 11,37
Distribution	$ 131 027	$ 102 552	$ 197 384
Actions émises en circulation	13 207	10 172	19 443
VNI par action	$ 9,92	$ 10,08	$ 10,15
Institutions en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 202 833	€ 233 199	€ 255 291
Actions émises en circulation	20 470	23 092	25 034
VNI par action	€ 9,91	€ 10,10	€ 10,20
Investisseurs :			
Capitalisation	$ 12 829	$ 18 474	$ 21 612
Actions émises en circulation	1 164	1 671	1 945
VNI par action	$ 11,02	$ 11,06	$ 11,11
Catégorie E :			
Capitalisation	$ 412 347	$ 467 026	$ 558 194
Actions émises en circulation	37 521	42 334	50 327
VNI par action	$ 10,99	$ 11,03	$ 11,09
Catégorie E en EUR (couverte) :			
Capitalisation	€ 44 471	€ 9 227	€ 11 970
Actions émises en circulation	4 656	944	1 208
VNI par action	€ 9,55	€ 9,77	€ 9,91
H Institutions :			
Capitalisation	$ 22 367	$ 33 914	$ 14 591
Actions émises en circulation	2 147	3 250	1 394
VNI par action	$ 10,42	$ 10,44	$ 10,47
Catégorie Z :			
Distribution	$ 602 189	$ 917 450	$ 964 005
Actions émises en circulation	60 375	90 541	94 476
VNI par action	$ 9,97	$ 10,13	$ 10,20

20. QUESTIONS RÉGLEMENTAIRES ET LITIGES

La Société n'est citée comme défendeur dans aucun litige ou procédure d'arbitrage important(e) et n'a pas connaissance d'un litige ou d'une réclamation important(e) effectué(e) ou n'en est pas menacée.

Ce qui précède ne s'applique qu'au 31 décembre 2022.

21. FACILITÉ DE CRÉDIT

PIMCO Funds: Global Investors Series plc, agissant pour le compte de chacun des Fonds Global High Yield Bond Fund et US High Yield Bond Fund (les « Fonds », individuellement un « Fonds ») a contracté une troisième facilité de crédit modifiée et mise à jour en date du 19 août 2022 (le « Contrat de crédit ») entre, notamment, les Fonds, certains prêteurs dont MUFG Bank Ltd. (« MUFG ») (en qualité de prêteur) et MUFG en qualité d'agent et de chef de file.

Chaque Fonds est autorisé à utiliser cette facilité à titre temporaire afin de financer les rachats aux actionnaires et à d'autres fins de liquidité à court terme visées dans sa politique d'investissement.

Sous réserve des termes du Contrat de crédit, l'engagement total disponible et pouvant être utilisé par les Fonds est de 285 000 000 $. Le montant total disponible pour les Fonds, ainsi que pour les autres emprunteurs (collectivement, les « Emprunteurs ») est, sous réserve des termes du Contrat de crédit, de 300 500 000 USD (le « Montant total engagé »). Les Emprunteurs peuvent, sous réserve des termes du Contrat de crédit, demander une augmentation du Montant total engagé allant jusqu'à 299 500 000 USD. Cet engagement supplémentaire serait disponible pour être utilisé par les Emprunteurs conformément aux termes du Contrat de crédit.

Le Contrat de crédit prévoit deux taux d'intérêt. Chaque Fonds, lorsqu'il utilise un prêt, choisira le taux d'intérêt qui s'appliquera à tout ou partie du prêt concerné, le taux applicable étant déterminé par référence au (i) Taux de base de substitution ou au (ii) SOFR simple quotidien ajusté.

Le Taux de base de substitution est, pour chaque jour donné, le taux le plus élevé entre (i) le taux directeur (tel que défini dans le Contrat de crédit) ou (ii) le Taux de financement bancaire au jour le jour (tel que défini dans le Contrat de crédit), en vigueur à cette date. Chaque prêt portant intérêt calculé par référence au Taux de base de substitution portera intérêt sur le principal en circulation pour la période commençant à la date à laquelle ce prêt est contracté jusqu'à la date à laquelle ce prêt est intégralement remboursé, sans tenir compte de la date à laquelle ce prêt est remboursé, à un taux annuel égal au Taux de base de substitution plus la Marge applicable (soit 1,125 %).

Le SOFR simple quotidien ajusté désigne un taux d'intérêt annuel égal (a) au SOFR simple quotidien (tel que défini dans le Contrat de crédit) plus (b) 0,10 %. Chaque prêt portant intérêt calculé par référence au SOFR simple quotidien ajusté portera intérêt sur le principal en circulation, pour la période commençant à la date à laquelle ce prêt est contracté ou repris jusqu'à la date à laquelle ce prêt est intégralement remboursé, en tenant compte de la date à laquelle ce prêt est remboursé, à un taux annuel égal au SOFR simple quotidien ajusté plus la Marge applicable (soit 1,125 %).

Sous réserve des conditions du Contrat de crédit, un prêt est remboursable dans les 60 jours suivant son tirage.

Tous les prêts sont fournis sans garantie et le recours des Prêteurs à un Fonds est limité aux actifs de ce Fonds.

Au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021, aucun des Fonds n'avait effectué d'emprunt aux termes du Contrat de crédit.

22. RÈGLEMENTATION DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT DE TITRES

La Réglementation relative aux opérations de financement de titres (« ROFT ») présente les obligations de reddition de compte et de communication relatives aux opérations de financement de titres (« OFT ») et aux swaps de rendement total. Les OFT sont définies en particulier par l'Article 3(11) de la ROFT comme suit :

- un contrat de mise/prise en pension,
- le prêt/emprunt de titres ou de matières premières,
- une opération d'achat suivie de revente ou de vente suivie d'un rachat dos-à-dos, ou
- une opération de prêt avec appel de marge.

(a) Données mondiales et concentration des contreparties OFT

Au 31 décembre 2022, les Fonds détenaient des swaps de rendement total et les types d'OFT suivants :

- Contrats de mise en pension
- Contrats de prise en pension
- Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos

La juste valeur des actifs/(passifs) de toutes les OFT et de tous les swaps de rendement total au 31 décembre 2022, groupés par type(s) d'OFT et les dix plus importantes contreparties sont les suivantes (si le nombre de contreparties est inférieur à dix, toutes les contreparties sont identifiées).

	31 décembre 2022	
Fonds	Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
SSB	$ 20 572	0,69
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
SSB	$ 820	0,26

Fonds	31 décembre 2022 Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds PIMCO Capital Securities Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 10 172	0,18
Contrats de prise en pension		
BPS	(71 348)	(1,25)
BRC	(4 860)	(0,08)
BYR	(59 977)	(1,05)
FBF	(2 857)	(0,05)
IND	(171 111)	(2,98)
JML	(135 138)	(2,36)
SCX	(133 184)	(2,34)
Total	(578 475)	(10,11)
Fonds PIMCO Climate Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
TDM	$ 36 800	12,57
Fonds Commodity Real Return Fund		
Swaps de rendement total		
BPS	$ (2 955)	(0,21)
CBK	(2 457)	(0,18)
CIB	(334)	(0,02)
FBF	(181)	(0,01)
GST	(3 476)	(0,25)
JPM	(345)	(0,03)
MAC	1 137	0,08
MEI	(251)	(0,02)
SOG	(497)	(0,04)
Total	(9 359)	(0,68)
Contrats de mise en pension		
FICC	613	0,04
IND	58 500	4,28
Total	59 113	4,32
Contrats de prise en pension		
BOS	(485)	(0,04)
CIB	(331 976)	(24,23)
GRE	(67 687)	(4,94)
RCY	(25 154)	(1,84)
Total	(425 302)	(31,05)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
BOS	(17 959)	(1,31)
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		
Swaps de rendement total		
BPS	$ (160)	(0,16)
Contrats de mise en pension		
BPS	6 300	6,48
FICC	610	0,63
Total	6 910	7,11
Fonds Diversified Income Fund		
Contrats de mise en pension		
BOS	$ 500 000	5,71
BRC	568 200	6,49
CIB	580 100	6,63
FICC	41 323	0,47
MBC	56 700	0,65
Total	1 746 323	19,95
Contrats de prise en pension		
BRC	(4 363)	(0,05)
JML	(2 283)	(0,03)
Total	(6 646)	(0,08)
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 102 832	18,21
Fonds Dynamic Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
BRC	$ 1 055 700	30,31
FICC	2 892	0,08
SAL	87 100	2,50
Total	1 145 692	32,89
Contrats de prise en pension		
DBL	(2 164)	(0,06)

Fonds	31 décembre 2022 Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund		
Swaps de rendement total		
BPS	€ 440	0,01
JPM	146	0,00
MEI	80	0,00
Total	666	0,01
Contrats de mise en pension		
BPS	22 818	0,45
CDI	100 000	1,96
FICC	1 786	0,03
Total	124 604	2,44
Contrats de prise en pension		
BPS	(17 828)	(0,35)
Fonds Emerging Local Bond Fund		
Contrats de prise en pension		
BPS	$ (39 132)	(2,04)
BRC	(46 181)	(2,41)
Total	(85 313)	(4,45)
Fonds Emerging Markets Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 9 160	0,28
Contrats de prise en pension		
BPS	(36 659)	(1,11)
BRC	(16 023)	(0,48)
MBC	(1 622)	(0,05)
MEI	(21 052)	(0,64)
Total	(75 356)	(2,28)
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 9 261	0,37
NOM	35 400	1,42
Total	44 661	1,79
Contrats de prise en pension		
BPS	(21 023)	(0,84)
BRC	(6 168)	(0,25)
MEI	(4 460)	(0,18)
NOM	(7 189)	(0,29)
Total	(38 840)	(1,56)
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	$ 6 100	3,61
FICC	2 286	1,35
Total	8 386	4,96
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund		
Contrats de mise en pension		
SSB	$ 706	0,35
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		
Contrats de mise en pension		
SAL	$ 2 500	11,95
SSB	266	1,27
Total	2 766	13,22
Fonds PIMCO ESG Income Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	$ 44 400	18,66
Fonds Euro Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	€ 10 900	0,57
FICC	615	0,03
Total	11 515	0,60
Fonds Euro Credit Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	€ 7 400	1,21
FICC	921	0,15
IND	36 300	5,95
Total	44 621	7,31

Fonds	31 décembre 2022 Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds Euro Income Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	€ 16 600	1,23
COM	100 000	7,38
FICC	3 858	0,29
Total	120 458	8,90
Fonds Euro Long Average Duration Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	€ 1 500	1,36
Fonds Euro Short-Term Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	€ 14 100	3,99
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	€ 3 700	2,12
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	€ 4 400	2,08
Fonds Global Advantage Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 1 408	0,34
Contrats de prise en pension		
MEI	(1 504)	(0,37)
Fonds Global Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	$ 660 000	5,77
CIB	562 700	4,93
FICC	124 270	1,09
Total	1 346 970	11,79
Contrats de prise en pension		
FBF	(1 682)	(0,01)
Fonds Global Bond ESG Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	$ 275 900	8,88
BRC	313 900	10,11
FICC	568 047	18,29
Total	1 157 847	37,28
Fonds Global Bond Ex-US Fund		
Swaps de rendement total		
BOA	$ 182	0,03
BPS	315	0,04
MYC	21	0,00
Total	518	0,07
Contrats de mise en pension		
FICC	1 625	0,23
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		
Swaps de rendement total		
BOA	$ 384	0,05
BPS	62	0,01
BRC	(49)	(0,01)
GST	(2)	0,00
JPM	192	0,03
MBC	(33)	0,00
MEI	7	0,00
MYI	(122)	(0,03)
SOG	118	0,02
Total	557	0,07
Contrats de mise en pension		
BPS	7 300	0,97
FICC	11 236	1,50
Total	18 536	2,47

Fonds	31 décembre 2022 Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds Global High Yield Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 7 812	0,25
NOM	3 600	0,12
Total	11 412	0,37
Contrats de prise en pension		
BRC	(5 516)	(0,18)
FBF	(2 419)	(0,08)
JML	(2 462)	(0,08)
Total	(10 397)	(0,34)
Fonds Global Investment Grade Credit Fund		
Contrats de mise en pension		
DEU	$ 30 800	0,29
FICC	29 223	0,28
SAL	15 400	0,15
Total	75 423	0,72
Contrats de prise en pension		
BRC	(2 721)	(0,03)
JML	(1 433)	(0,01)
Total	(4 154)	(0,04)
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund		
Contrats de mise en pension		
SSB	$ 15 240	1,11
Contrats de prise en pension		
BOS	(75 130)	(5,48)
BRC	(798)	(0,06)
Total	(75 928)	(5,54)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
BPG	(75 242)	(5,49)
MSC	(684)	(0,05)
Total	(75 926)	(5,54)
Fonds Global Low Duration Real Return Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 1 053	0,08
Contrats de prise en pension		
CIB	(190 632)	(13,97)
DEU	(71 081)	(5,21)
Total	(261 713)	(19,18)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
BRC	(69 575)	(5,10)
TDM	(10 024)	(0,73)
Total	(79 599)	(5,83)
Fonds Global Real Return Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 2 245	0,09
Contrats de prise en pension		
BOS	(14 838)	(0,58)
BRC	(3 159)	(0,12)
BSN	(554 549)	(21,56)
CIB	(171 691)	(6,68)
GRE	(51 915)	(2,02)
Total	(796 152)	(30,96)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
BOS	(9 519)	(0,37)
Fonds Income Fund		
Swaps de rendement total		
BOA	$ 80	0,00
GST	(735)	0,00
Total	(655)	0,00
Contrats de mise en pension		
BOS	500 000	0,86
DEU	116 100	0,20
FICC	2 037 659	3,51
MBC	644 900	1,11
SGY	113 800	0,20
SOG	9 239	0,02
Total	3 421 698	5,90
Contrats de prise en pension		
BRC	(5 155)	(0,01)
DBL	(10 712)	(0,02)
Total	(15 867)	(0,03)

Fonds	31 décembre 2022 Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds Inflation Multi-Asset Fund		
Swaps de rendement total		
BPS	$ (373)	(0,09)
BRC	(21)	(0,01)
CBK	(76)	(0,02)
GST	(118)	(0,03)
JPM	17	0,00
MAC	192	0,05
MYI	(362)	(0,09)
SOG	(48)	(0,01)
Total	(789)	(0,20)
Contrats de mise en pension		
GSC	37 700	9,34
SSB	3 020	0,76
Total	40 720	10,10
Fonds Low Average Duration Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 956	0,09
Contrats de prise en pension		
BOS	(128 895)	(12,01)
GRE	(15 962)	(1,49)
Total	(144 857)	(13,50)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
CSN	(4 077)	(0,38)
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 1 604	0,24
Contrats de prise en pension		
BOS	(2 415)	(0,37)
BRC	(607)	(0,09)
GRE	(9 754)	(1,49)
Total	(12 776)	(1,95)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
BPG	(1 409)	(0,22)
Fonds Low Duration Income Fund		
Swaps de rendement total		
GST	$ (2)	0,00
Contrats de mise en pension		
FICC	5 431	0,50
MBC	93 400	8,61
Total	98 831	9,11
Fonds Low Duration Opportunities Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 118 800	8,83
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		
Swaps de rendement total		
BOA	$ (130)	(0,10)
CBK	(8)	(0,01)
FAR	(18)	(0,01)
JPM	(1)	0,00
MYI	16	0,01
Total	(141)	(0,11)
Contrats de mise en pension		
SSB	811	0,68
Fonds Mortgage Opportunities Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	$ 13 700	1,61
FICC	3 618	0,43
Total	17 318	2,04
Contrats de prise en pension		
CIB	(264 111)	(31,10)
JPS	(724)	(0,09)
RCY	(23 192)	(2,73)
SCX	(28 466)	(3,35)
Total	(316 493)	(37,27)

Fonds	31 décembre 2022 Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds StocksPLUS™ Fund		
Swaps de rendement total		
FAR	$ (1 148)	(0,11)
MBC	(120)	(0,01)
RBC	(1 063)	(0,11)
UBS	(35)	(0,01)
Total	(2 366)	(0,24)
Contrats de mise en pension		
BOS	20 300	2,01
FICC	14 743	1,46
NOM	60 000	5,95
SGY	24 500	2,43
TOR	36 902	3,67
Total	156 445	15,52
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		
Swaps de rendement total		
BRC	$ (4)	(0,04)
FAR	(16)	(0,16)
RBC	(17)	(0,19)
Total	(37)	(0,39)
Contrats de mise en pension		
BPS	1 200	12,59
SSB	174	1,83
Total	1 374	14,42
Fonds Strategic Income Fund		
Swaps de rendement total		
GST	$ (4)	0,00
Contrats de mise en pension		
FICC	781	0,15
Fonds Total Return Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
BOS	$ 26 100	0,63
FICC	144 795	3,49
Total	170 895	4,12
Contrats de prise en pension		
BRC	(1 745)	(0,04)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
BPG	(76 809)	(1,85)
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		
Swaps de rendement total		
MEI	$ (165)	(0,04)
Contrats de mise en pension		
BPS	22 700	5,21
SSB	4 752	1,09
Total	27 452	6,30
Fonds UK Corporate Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	£ 177	0,05
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	£ 269	0,08
Fonds US High Yield Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 9 269	0,47
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
BOS	$ 12 800	3,30
FICC	2 583	0,66
Total	15 383	3,96
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
BPG	(38 655)	(9,95)
Fonds US Short-Term Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 154 472	6,69

Au 31 décembre 2021, les Fonds détenaient des swaps de rendement total et les types d'OFT suivants :

- Contrats de mise en pension
- Contrats de prise en pension
- Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos

La juste valeur des actifs/(passifs) de toutes les OFT et de tous les swaps de rendement total au 31 décembre 2021, groupés par type(s) d'OFT et les dix plus importantes contreparties sont les suivantes (si le nombre de contreparties est inférieur à dix, toutes les contreparties sont identifiées).

	31 décembre 2021	
Fonds	**Juste valeur (en milliers)**	**En % de l'actif net**
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund		
Swaps de rendement total		
DBL	$ 69	0,00
Contrats de mise en pension		
IND	75 000	2,20
SSB	103 712	3,04
Total	178 712	5,24
Contrats de prise en pension		
BPS	(9 016)	(0,27)
BRC	(34 792)	(1,01)
JML	(5 040)	(0,15)
Total	(48 848)	(1,43)
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund		
Swaps de rendement total		
DBL	$ 25	0,01
Contrats de mise en pension		
SSB	837	0,23
Contrats de prise en pension		
BPS	(348)	(0,10)
BRC	(676)	(0,18)
Total	(1 024)	(0,28)
Fonds PIMCO Capital Securities Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 14 423	0,16
IND	48 100	0,53
Total	62 523	0,69
Contrats de prise en pension		
BPS	(4 109)	(0,05)
BRC	(6 687)	(0,07)
JML	(10 246)	(0,11)
TDM	(2 297)	(0,03)
Total	(23 339)	(0,26)
Fonds Commodity Real Return Fund		
Swaps de rendement total		
BPS	$ 9 677	0,67
CBK	5 715	0,40
CIB	1 202	0,08
FBF	651	0,05
GST	11 216	0,78
JPM	20 289	1,40
MAC	1 646	0,11
MEI	2 152	0,15
SOG	859	0,06
Total	53 407	3,70
Contrats de mise en pension		
FICC	2 098	0,15
Contrats de prise en pension		
GRE	(22 915)	(1,59)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
MSC	(80 800)	(5,59)
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 1 827	1,31

	31 décembre 2021	
Fonds	**Juste valeur (en milliers)**	**En % de l'actif net**
Fonds Diversified Income Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	$ 76 100	0,47
FICC	81 216	0,49
Total	157 316	0,96
Contrats de prise en pension		
BPS	(5 516)	(0,03)
BRC	(18 608)	(0,11)
FBF	(29 496)	(0,18)
JML	(28 249)	(0,18)
Total	(81 869)	(0,50)
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 7 030	0,54
IND	51 900	3,97
Total	58 930	4,51
Contrats de prise en pension		
BPS	(1 888)	(0,14)
GST	(2 957)	(0,23)
Total	(4 845)	(0,37)
Fonds Dynamic Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 9 965	0,30
Contrats de prise en pension		
BPS	(4 539)	(0,14)
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund		
Swaps de rendement total		
BPS	€ (57)	0,00
BRC	(2)	0,00
Total	(59)	0,00
Contrats de mise en pension		
BPS	114 800	1,50
FICC	8 276	0,11
IND	79 200	1,04
Total	202 276	2,65
Fonds Emerging Local Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 591	0,03
Contrats de prise en pension		
BPS	(12 365)	(0,57)
BRC	(89 609)	(4,16)
DBL	(11 372)	(0,53)
JML	(112 133)	(5,22)
MBC	(35 127)	(1,63)
SCX	(99 720)	(4,64)
UBS	(14 417)	(0,67)
Total	(374 743)	(17,42)
Fonds Emerging Markets Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	$ 42 700	0,91
FICC	7 623	0,16
Total	50 323	1,07
Contrats de prise en pension		
BPS	(91 031)	(1,93)
BRC	(19 110)	(0,40)
FBF	(14 102)	(0,30)
JML	(28 314)	(0,61)
MEI	(13 673)	(0,29)
Total	(166 230)	(3,53)
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	$ 14 600	0,55
FICC	3 343	0,13
SGY	33 200	1,26
Total	51 143	1,94

Fonds	31 décembre 2021 Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund (suite)		
Contrats de prise en pension		
BPS	$ (64 683)	(2,45)
BRC	(10 692)	(0,41)
FBF	(7 843)	(0,30)
JML	(29 437)	(1,11)
NOM	(4 740)	(0,18)
SCX	(47 047)	(1,79)
TDM	(2 761)	(0,10)
Total	(167 203)	(6,34)
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 487	0,23
Fonds Emerging Markets Opportunities Fund		
Contrats de mise en pension		
SSB	$ 688	0,24
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund		
Contrats de mise en pension		
SSB	$ 193	0,65
Fonds Euro Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
COM	€ 22 300	0,87
FICC	2 416	0,09
Total	24 716	0,96
Fonds Euro Credit Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	€ 5 883	0,58
Fonds Euro Income Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
COM	€ 6 400	0,25
FICC	1 151	0,05
Total	7 551	0,30
Contrats de prise en pension		
SCX	(3 195)	(0,13)
Fonds Euro Long Average Duration Fund		
Contrats de mise en pension		
COM	€ 1 100	0,69
FICC	136	0,08
Total	1 236	0,77
Fonds Euro Short-Term Fund		
Contrats de mise en pension		
COM	€ 25 900	4,11
FICC	637	0,10
Total	26 537	4,21
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	€ 4 900	2,87
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		
Contrats de mise en pension		
COM	€ 10 800	2,73
FICC	881	0,22
Total	11 681	2,95
Contrats de prise en pension		
FBF	(611)	(0,15)
Fonds Global Advantage Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 206	0,04
Contrats de prise en pension		
BRC	(13 753)	(2,64)
GRE	(14 899)	(2,86)
MYI	(6 798)	(1,30)
Total	(35 450)	(6,80)

Fonds	31 décembre 2021 Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds Global Bond Fund		
Swaps de rendement total		
CIB	$ 101	0,00
Contrats de mise en pension		
FICC	3 378	0,02
Contrats de prise en pension		
BRC	(12 048)	(0,09)
CIB	(611 552)	(4,35)
GRE	(189 959)	(1,35)
IND	(16 959)	(0,12)
JML	(336 833)	(2,40)
Total	(1 166 988)	(8,31)
Fonds Global Bond ESG Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	$ 32 600	1,41
FICC	5 654	0,25
Total	38 254	1,66
Fonds Global Bond Ex-US Fund		
Swaps de rendement total		
BPS	$ 83	0,01
CIB	1	0,00
GST	51	0,00
Total	135	0,01
Contrats de mise en pension		
FICC	1 246	0,14
Contrats de prise en pension		
BRC	(26 064)	(2,86)
IND	(9 437)	(1,03)
JML	(20 622)	(2,26)
MYI	$ (41 132)	(4,51)
UBS	(2 251)	(0,25)
Total	(99 506)	(10,91)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
MSC	(8 467)	(0,93)
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		
Swaps de rendement total		
BOA	$ (333)	(0,03)
BPS	26	0,00
JPM	80	0,01
SOG	18	0,00
Total	(209)	(0,02)
Contrats de mise en pension		
FICC	511	0,05
Fonds Global High Yield Bond Fund		
Swaps de rendement total		
BRC	$ 77	0,00
MYC	739	0,02
Total	816	0,02
Contrats de prise en pension		
BRC	(12 814)	(0,25)
JML	(3 058)	(0,06)
Total	(15 872)	(0,31)
Fonds Global Investment Grade Credit Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 4 429	0,03
Contrats de prise en pension		
BRC	(6 220)	(0,03)
FBF	(1 160)	(0,01)
Total	(7 380)	(0,04)
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund		
Contrats de mise en pension		
SSB	$ 962	0,08
Fonds Global Low Duration Real Return Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 1 138	0,09
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
BRC	(68 642)	(5,73)
CSN	(182 164)	(15,19)
Total	(250 806)	(20,92)

Fonds	31 décembre 2021 Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds Global Real Return Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 5 680	0,15
Contrats de prise en pension		
GRE	(217 149)	(5,86)
MYI	(20 667)	(0,56)
NOM	(534 885)	(14,44)
Total	(772 701)	(20,86)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
BRC	(45 534)	(1,23)
MSC	(290 315)	(7,84)
Total	(335 849)	(9,07)
Fonds Income Fund		
Swaps de rendement total		
BPS	$ 257	0,00
MYC	3 317	0,00
Total	3 574	0,00
Contrats de mise en pension		
BOS	2 796 100	3,79
BPS	134 300	0,18
BRC	653 100	0,89
BSN	230 400	0,31
CIB	1 500 000	2,04
FICC	14 233	0,02
JPS	130 000	0,18
MBC	608 100	0,83
NXN	250 000	0,34
TDM	49 400	0,07
Total	6 365 633	8,65
Contrats de prise en pension		
BPS	(43 630)	(0,06)
BRC	(10 270)	(0,01)
FBF	$ (14 088)	(0,02)
JML	(4 228)	(0,01)
TDM	(856)	0,00
Total	(73 072)	(0,10)
Fonds Inflation Multi-Asset Fund		
Swaps de rendement total		
BOA	$ 11	0,01
BPS	252	0,15
CBK	87	0,04
FAR	(1)	0,00
GST	89	0,06
JPM	354	0,22
MAC	4	0,00
MYI	93	0,06
SOG	39	0,02
UAG	(2)	0,00
Total	926	0,56
Contrats de mise en pension		
SSB	500	0,30
Fonds Low Average Duration Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 2 677	0,23
RDR	21 500	1,82
Total	24 177	2,05
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 892	0,11
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
BRC	(2 682)	(0,33)

Fonds	31 décembre 2021 Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds Low Duration Income Fund		
Swaps de rendement total		
BPS	$ 2	0,00
BRC	1	0,00
MYC	4	0,00
Total	7	0,00
Contrats de mise en pension		
FICC	7 961	0,58
Fonds Low Duration Opportunities Fund		
Contrats de mise en pension		
BPS	$ 68 000	2,12
FICC	4 663	0,14
Total	72 663	2,26
Contrats de prise en pension		
BPS	(1 088)	(0,03)
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund		
Swaps de rendement total		
BOA	$ (2)	0,00
CBK	302	0,31
FAR	(4)	(0,01)
MYI	11	0,01
Total	307	0,31
Fonds Mortgage Opportunities Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 2 125	0,09
Contrats de prise en pension		
BOS	(347 158)	(15,51)
CIB	(16 761)	(0,75)
Total	(363 919)	(16,26)
Fonds StocksPLUS™ Fund		
Swaps de rendement total		
BOA	$ 612	0,02
CBK	5 147	0,13
FAR	19 666	0,53
GST	(20)	0,00
HUS	1 674	0,04
RBC	16 517	0,44
UAG	9 318	0,25
Total	52 914	1,41
Contrats de mise en pension		
BPS	300 000	7,97
FICC	7 712	0,21
GSC	$ 163 800	4,36
MFK	550 000	14,62
RVM	450 000	11,96
Total	1 471 512	39,12
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		
Swaps de rendement total		
FAR	$ 213	1,83
GST	(5)	(0,04)
Total	208	1,79
Contrats de mise en pension		
BPS	1 300	11,19
SSB	132	1,14
Total	1 432	12,33
Fonds Strategic Income Fund		
Swaps de rendement total		
BPS	$ 2	0,00
BRC	1	0,00
MYC	2	0,00
Total	5	0,00
Contrats de mise en pension		
FICC	476	0,08
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
BRC	(1 841)	(0,30)

Fonds	31 décembre 2021 Juste valeur (en milliers)	En % de l'actif net
Fonds Total Return Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 7 152	0,14
Contrats de prise en pension		
BRC	(11 267)	(0,24)
GRE	(119 489)	(2,41)
IND	(95 095)	(1,92)
Total	(225 851)	(4,57)
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		
Swaps de rendement total		
MEI	$ 94	0,09
Contrats de mise en pension		
SSB	800	0,79
Fonds UK Corporate Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	£ 526	0,09
Contrats de prise en pension		
FBF	(513)	(0,09)
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	£ 442	0,10
Contrats de prise en pension		
FBF	(513)	(0,12)
Fonds US High Yield Bond Fund		
Swaps de rendement total		
BRC	$ 898	0,03
Contrats de mise en pension		
FICC	1 473	0,04
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 686	0,08
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
BPG	(6 735)	(0,77)
CSN	(19 775)	(2,25)
Total	(26 510)	(3,02)
Fonds US Short-Term Fund		
Contrats de mise en pension		
FICC	$ 1 571	0,06
Contrats de prise en pension		
SGY	(215 091)	(8,12)
Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos		
BRC	(56 138)	(2,12)
CSN	(181 617)	(6,85)
Total	(237 755)	(8,97)

(b) Garantie

(i) Garde des garanties reçues :

Les garanties reçues au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 sont détenues au sein du réseau de dépositaire international de State Street Bank and Trust en tant que société mère ultime du Dépositaire.

(ii) Données sur la concentration :

Les dix premiers émetteurs de titres reçus en garantie toutes OFT confondues au 31 décembre 2022 sont les suivants. Si le nombre d'émetteurs est inférieur à dix, tous les émetteurs sont identifiés ci-dessous :

Fonds	Au 31 décembre 2022 Émetteur de garantie	Juste valeur (en milliers)
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	$ 20 983
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	836
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	Gouvernement des États-Unis	10 375
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	38 412
Fonds Commodity Real Return Fund	Gouvernement des États-Unis	61 286
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	7 060

Fonds	Au 31 décembre 2022 Émetteur de garantie	Juste valeur (en milliers)
Fonds Diversified Income Fund	Freddie Mac	$ 139 541
	Ginnie Mae	450 224
	Gouvernement des États-Unis	1 205 939
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Gouvernement des États-Unis	104 889
	Freddie Mac	139 541
	Ginnie Mae	413 154
Fonds Dynamic Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	621 400
	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	€ 100 270
	Union européenne	18 150
	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	161
	Landwirtschaftliche Rentenbank	4 907
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	Gouvernement des États-Unis	1 822
Fonds Emerging Markets Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	$ 9 343
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	Gouvernement des États-Unis	45 570
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	8 567
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Gouvernement des États-Unis	720
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Gouvernement des États-Unis	2 820
Fonds PIMCO ESG Income Fund	Gouvernement des États-Unis	45 259
	BNG Bank NV	€ 11 063
Fonds Euro Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	627
	BNG Bank NV	2 776
	Bpifrance SACA	483
	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	568
	Union européenne	25 098
	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	4 431
	Landwirtschaftliche Rentenbank	8 536
	État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie	837
	UNEDIC	1 626
Fonds Euro Credit Fund	Gouvernement des États-Unis	940
	BNG Bank NV	16 819
	État de Berlin	102 209
Fonds Euro Income Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	3 935
Fonds Euro Long Average Duration Fund	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	1 517
Fonds Euro Short-Term Fund	BNG Bank NV	14 286
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	3 743
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	4 454
Fonds Global Advantage Fund	Gouvernement des États-Unis	$ 1 436
Fonds Global Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	1 378 007
Fonds Global Bond ESG Fund	Gouvernement des États-Unis	1 181 854
Fonds Global Bond Ex-US Fund	Gouvernement des États-Unis	1 658
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Gouvernement des États-Unis	18 879
Fonds Global High Yield Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	11 642
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	Gouvernement des États-Unis	76 925
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	Gouvernement des États-Unis	15 545
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	Gouvernement des États-Unis	1 074
Fonds Global Real Return Fund	Gouvernement des États-Unis	2 391

Fonds	Au 31 décembre 2022 Émetteur de garantie	Juste valeur (en milliers)
Fonds Income Fund	Gouvernement des États-Unis	$ 3 498 550
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	Freddie Mac	38 846
	Gouvernement des États-Unis	3 080
Fonds Low Average Duration Fund	Gouvernement des États-Unis	975
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Gouvernement des États-Unis	1 636
Fonds Low Duration Income Fund	Gouvernement des États-Unis	101 947
Fonds Low Duration Opportunities Fund	Gouvernement des États-Unis	121 176
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Gouvernement des États-Unis	827
Fonds Mortgage Opportunities Fund	Gouvernement des États-Unis	17 694
Fonds StocksPLUS™ Fund	Gouvernement du Canada	36 902
	Gouvernement des États-Unis	122 051
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Gouvernement des États-Unis	1 405
Fonds Strategic Income Fund	Gouvernement des États-Unis	797
Fonds Total Return Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	174 491
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Gouvernement des États-Unis	28 016
Fonds UK Corporate Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	£ 181
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	274
Fonds US High Yield Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	$ 9 454
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	15 768
Fonds US Short-Term Fund	Gouvernement des États-Unis	157 561

Les dix premiers émetteurs de titres reçus en garantie toutes OFT confondues au 31 décembre 2021 sont les suivants. Si le nombre d'émetteurs est inférieur à dix, tous les émetteurs sont identifiés ci-dessous :

Fonds	Au 31 décembre 2021 Émetteur de garantie	Juste valeur (en milliers)
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	$ 182 416
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	854
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	Gouvernement des États-Unis	63 857
Fonds Commodity Real Return Fund	Gouvernement des États-Unis	2 140
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	1 864
Fonds Diversified Income Fund	Gouvernement des États-Unis	160 513
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Gouvernement des États-Unis	60 199
Fonds Dynamic Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	10 164
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	Agence Française de Développement	€ 15 624
	Dexia Credit Local S.A.	7 755
	Union européenne	22 936
	Gouvernement allemand	70 334
	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	48 246
	SNCF Réseau	28 392
	Gouvernement des États-Unis	8 441
Fonds Emerging Local Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	$ 603
Fonds Emerging Markets Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	51 353
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	Gouvernement des États-Unis	52 182
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	497
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Gouvernement des États-Unis	702
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Gouvernement des États-Unis	197
Fonds Euro Bond Fund	Gouvernement allemand	€ 22 175
	Gouvernement des États-Unis	2 464
Fonds Euro Credit Fund	Gouvernement des États-Unis	6 001
Fonds Euro Income Bond Fund	Gouvernement allemand	6 350
	Gouvernement des États-Unis	1 174
Fonds Euro Long Average Duration Fund	Gouvernement allemand	1 106
	Gouvernement des États-Unis	139
Fonds Euro Short-Term Fund	NRW Bank	25 716
	Gouvernement des États-Unis	649
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	UNEDIC	5 091
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Gouvernement allemand	10 750
	Gouvernement des États-Unis	899
Fonds Global Advantage Fund	Gouvernement des États-Unis	$ 210
Fonds Global Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	3 446
Fonds Global Bond ESG Fund	Gouvernement des États-Unis	39 022
Fonds Global Bond Ex-US Fund	Gouvernement des États-Unis	1 271
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Gouvernement des États-Unis	521
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	Gouvernement des États-Unis	4 518
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	Gouvernement des États-Unis	981
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	Gouvernement des États-Unis	1 161
Fonds Global Real Return Fund	Gouvernement des États-Unis	11 471
Fonds Income Fund	Gouvernement des États-Unis	6 515 251
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	Gouvernement des États-Unis	510
Fonds Low Average Duration Fund	Gouvernement des États-Unis	24 667
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Gouvernement des États-Unis	910
Fonds Low Duration Income Fund	Gouvernement des États-Unis	8 120
Fonds Low Duration Opportunities Fund	Gouvernement des États-Unis	74 161
Fonds Mortgage Opportunities Fund	Fannie Mae	94
	Gouvernement des États-Unis	2 168
Fonds StocksPLUS™ Fund	Fannie Mae	170 372
	Ginnie Mae	310 742
	Gouvernement des États-Unis	1 029 581
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Gouvernement des États-Unis	1 461
Fonds Strategic Income Fund	Gouvernement des États-Unis	$ 486
Fonds Total Return Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	7 295
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Gouvernement des États-Unis	816
Fonds UK Corporate Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	£ 537
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	451
Fonds US High Yield Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	$ 1 503
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	Gouvernement des États-Unis	700
Fonds US Short-Term Fund	Gouvernement des États-Unis	1 602

(iii) Données agrégées sur les transactions :

Les données agrégées sur les transactions correspondant aux positions de garantie (en numéraire notamment) reçues toutes OTF et tous swaps de rendement total confondus au 31 décembre 2022 sont telles que suit :

Fonds	Type de valeur mobilière	Description de la garantie	Type de garantie	Juste valeur (en milliers)	Qualité	Échéance de la garantie	Devise de la garantie	Pays d'établissement de la contrepartie	Règlement et compensation
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	$ 20 983	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	836	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	10 375	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	3 516	S/O	S/O	USD	Canada	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	6 877	S/O	S/O	USD	France	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	264	S/O	S/O	EUR	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	7 614	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	Contrats de mise en pension	Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	38 412	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Commodity Real Return Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	840	S/O	S/O	USD	Australie	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	1 310	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	625	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	60 504	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	157	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	622	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	6 438	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
Fonds Diversified Income Fund	Contrats de mise en pension	Freddie Mac	Mortgage Pass Thru	139 541	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	450 224	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	58 078	AAA	3 mois - 1 an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	42 150	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	513 516	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	592 195	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	277	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	2 481	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	102 408	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Dynamic Bond Fund	Contrats de mise en pension	Freddie Mac	Mortgage Pass Thru	139 541	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	413 154	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	2 950	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	529 681	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	88 769	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	€ 10 200	S/O	S/O	EUR	France	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	4 040	S/O	S/O	EUR	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	7 080	S/O	S/O	EUR	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	Bons du Trésor	100 270	AA	3 mois - 1 an	EUR	France	FED, bilatéral
		Mécanisme européen de stabilité	Bons du Trésor	18 150	AAA	1 à 3 mois	EUR	France	FED, bilatéral
		Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Entreprises	161	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Landwirtschaftliche Rentenbank	Entreprises	4 907	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	1 822	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Emerging Markets Bond Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	$ 9 343	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	2 609	S/O	S/O	USD	France	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	393	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	9 446	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	36 124	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	807	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral

Fonds	Type de valeur mobilière	Description de la garantie	Type de garantie	Juste valeur (en milliers)	Qualité	Échéance de la garantie	Devise de la garantie	Pays d'établissement de la contrepartie	Règlement et compensation
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	$ 2 332	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	6 235	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	720	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	2 549	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	271	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO ESG Income Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	45 259	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
Fonds Euro Bond Fund	Contrats de mise en pension	BNG Bank NV	Bons du Trésor	€ 11 063	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	627	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Euro Credit Fund	Contrats de mise en pension	BNG Bank NV	Bons du Trésor	2 776	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Bpifrance SACA	Bons du Trésor	483	AA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Caisse d'Amortissement de la Dette Sociale	Bons du Trésor	568	AA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Banque de développement du Conseil de l'Europe	Bons du Trésor	784	AA+	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Mécanisme européen de stabilité	Bons du Trésor	4 996	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Banque européenne d'investissement	Bons du Trésor	6 798	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Union européenne	Bons du Trésor	12 520	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Entreprises	979	AAA	3 mois - 1 an	EUR	France	FED, bilatéral
		Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Entreprises	3 452	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Landwirtschaftliche Rentenbank	Entreprises	8 536	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie	Bons du Trésor	837	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		UNEDIC	Bons du Trésor	1 626	AA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	940	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Euro Income Bond Fund	Contrats de mise en pension	BNG Bank NV	Bons du Trésor	16 819	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		État de Berlin	Bons du Trésor	102 209	AAA	Plus d'un an	EUR	Allemagne	FED, bilatéral
		Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	3 935	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Euro Long Average Duration Fund	Contrats de mise en pension	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Entreprises	1 517	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
Fonds Euro Short-Term Fund	Contrats de mise en pension	BNG Bank NV	Bons du Trésor	14 286	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	Contrats de mise en pension	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Entreprises	3 743	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Contrats de mise en pension	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Entreprises	4 454	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
Fonds Global Advantage Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	$ 1 436	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global Bond Fund	Contrats de mise en pension	Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	307 187	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	269 857	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	674 208	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	126 755	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral

Fonds	Type de valeur mobilière	Description de la garantie	Type de garantie	Juste valeur (en milliers)	Qualité	Échéance de la garantie	Devise de la garantie	Pays d'établissement de la contrepartie	Règlement et compensation
Fonds Global Bond ESG Fund	Contrats de mise en pension	Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	$ 320 650	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	36 147	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	281 796	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	543 261	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global Bond Ex-US Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	530	S/O	S/O	USD	France	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	1 658	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	1 660	S/O	S/O	USD	France	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	1 560	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	590	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	11 461	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	7 418	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
Fonds Global High Yield Bond Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	7 968	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	3 674	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	205	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	29 808	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	31 422	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	15 695	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	15 545	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	1 074	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global Real Return Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	2 290	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	101	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Income Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	404 498	AAA	Jusqu'à 1 mois	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	82 219	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	9 894	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	747 747	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	323 152	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	257 998	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	1 673 042	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	273	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	1	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	240	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Freddie Mac	Mortgage Pass Thru	38 846	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	3 080	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Low Average Duration Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	975	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	1 636	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Low Duration Income Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	5 540	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	96 407	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds Low Duration Opportunities Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	121 176	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral

Fonds	Type de valeur mobilière	Description de la garantie	Type de garantie	Juste valeur (en milliers)	Qualité	Échéance de la garantie	Devise de la garantie	Pays d'établissement de la contrepartie	Règlement et compensation
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	$ 370	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	827	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Mortgage Opportunities Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	3 690	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	14 004	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	4 656	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds StocksPLUS™ Fund	Contrats de mise en pension	Province de l'Ontario	Bons du Trésor	36 902	AA-	Plus d'un an	CAD	Canada	FED, bilatéral
		Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	15 038	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	107 013	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	1 227	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	178	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Strategic Income Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	797	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Total Return Bond Fund	Contrats de mise en pension	Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	26 800	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	5 911	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	141 780	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	23 169	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	4 847	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds UK Corporate Bond Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	£ 181	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	274	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds US High Yield Bond Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	$ 9 454	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	Contrats de mise en pension	Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	13 133	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	2 635	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds US Short-Term Fund	Contrats de mise en pension	Bons du Trésor américain	Bons du Trésor	2 725	AAA	3 mois - 1 an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	154 836	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral

Les données agrégées sur les transactions correspondant aux positions de garantie (en numéraire notamment) reçues toutes OTF et tous swaps de rendement total confondus au 31 décembre 2021 sont telles que suit :

Fonds	Type de valeur mobilière	Description de la garantie	Type de garantie	Juste valeur (en milliers)	Qualité	Échéance de la garantie	Devise de la garantie	Pays d'établissement de la contrepartie	Règlement et compensation
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	Contrats de mise en pension	Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	$ 76 630	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	105 786	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	854	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	Contrats de mise en pension	Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	49 146	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	14 711	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Commodity Real Return Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	1 770	S/O	S/O	USD	Australie	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	11 740	S/O	S/O	USD	France	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	15 180	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	29 630	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	2 140	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	Contrats de mise en pension	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	1 864	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral

Fonds	Type de valeur mobilière	Description de la garantie	Type de garantie	Juste valeur (en milliers)	Qualité	Échéance de la garantie	Devise de la garantie	Pays d'établissement de la contrepartie	Règlement et compensation
Fonds Diversified Income Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	$ 77 673	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	82 840	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	308	S/O	S/O	EUR	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	Contrats de mise en pension	Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	53 028	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	7 171	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Dynamic Bond Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	10 164	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	250	S/O	S/O	USD	France	FED, bilatéral
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	Contrats de mise en pension	Agence Française de Développement	Entreprises	€ 15 624	AA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Dexia Credit Local S.A.	Entreprises	7 755	BBB+	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	Entreprises	48 246	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Union européenne	Bons du Trésor	22 936	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		SNCF Réseau	Bons du Trésor	28 392	AA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie	Bons du Trésor	25 432	AAA	3 mois - 1 an	EUR	France	FED, bilatéral
		État de Rhénanie-du-Nord-Westphalie	Bons du Trésor	44 902	AAA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	8 441	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Emerging Local Bond Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	$ 603	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	968	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds Emerging Markets Bond Fund	Contrats de mise en pension	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	7 776	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	43 577	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	408	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	Contrats de mise en pension	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	14 893	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	3 410	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	33 879	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	1 001	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	497	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	702	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	197	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Euro Bond Fund	Contrats de mise en pension	État de Basse-Saxe	Bons du Trésor	€ 22 175	AAA	Plus d'un an	EUR	Allemagne	FED, bilatéral
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	2 464	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Euro Credit Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	6 001	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral

Fonds	Type de valeur mobilière	Description de la garantie	Type de garantie	Juste valeur (en milliers)	Qualité	Échéance de la garantie	Devise de la garantie	Pays d'établissement de la contrepartie	Règlement et compensation
Fonds Euro Income Bond Fund	Contrats de mise en pension	État de Hesse	Bons du Trésor	€ 6,350	AAA	Plus d'un an	EUR	Allemagne	FED, bilatéral
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	105	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	1 069	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Euro Long Average Duration Fund	Contrats de mise en pension	État de Basse-Saxe	Bons du Trésor	1 106	AAA	3 mois - 1 an	EUR	Allemagne	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	139	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Euro Short-Term Fund	Contrats de mise en pension	NRW Bank	Entreprises	25 716	AAA	Plus d'un an	EUR	Allemagne	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	649	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	Contrats de mise en pension	UNEDIC	Bons du Trésor	5 091	AA	Plus d'un an	EUR	France	FED, bilatéral
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	Contrats de mise en pension	État de Basse-Saxe	Bons du Trésor	10 750	AAA	Plus d'un an	EUR	Allemagne	FED, bilatéral
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	899	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global Advantage Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	$ 210	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global Bond Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	400	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	3 446	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global Bond ESG Fund	Contrats de mise en pension	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	33 255	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	5 767	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global Bond Ex-US Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	1 271	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	Contrats de mise en pension	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	521	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global High Yield Bond Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	710	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	4 518	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	20	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	981	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	1 161	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Global Real Return Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	5 794	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	678	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	5 677	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Income Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	58 410	S/O	S/O	USD	France	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	41 710	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	235 321	AAA	Plus d'un an	USD	Canada	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	702 189	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	2 681 812	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	136 997	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	58 852	AAA	3 mois - 1 an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral

Fonds	Type de valeur mobilière	Description de la garantie	Type de garantie	Juste valeur (en milliers)	Qualité	Échéance de la garantie	Devise de la garantie	Pays d'établissement de la contrepartie	Règlement et compensation
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	$ 225 894	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	816 286	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	309 469	AAA	Plus d'un an	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	1 348 431	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	840	S/O	S/O	USD	France	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	1 035	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	280	S/O	S/O	USD	France	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	260	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	860	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	510	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Low Average Duration Fund	Contrats de mise en pension	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	2 731	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	21 936	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	910	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Low Duration Income Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	1 330	S/O	S/O	USD	France	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	1 290	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	410	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	8 120	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Low Duration Opportunities Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	69 405	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	4 756	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	610	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	730	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Mortgage Opportunities Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	2 168	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Fannie Mae	Mortgage Pass Thru	94	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds StocksPLUS™ Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	35 390	S/O	S/O	USD	Canada	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	2 240	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	69 635	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Fannie Mae	Mortgage Pass Thru	170 372	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Ginnie Mae	Mortgage Pass Thru	310 742	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Obligations du Trésor américain	Bons du Trésor	562 569	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	7 866	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	459 146	AAA	Plus d'un an	USD	Îles Caïmans	FED, bilatéral
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	530	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
		Garantie en numéraire	Liquidités	270	S/O	S/O	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	1 326	AAA	Plus d'un an	USD	France	FED, bilatéral
		Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	135	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral

Fonds	Type de valeur mobilière	Description de la garantie	Type de garantie	Juste valeur (en milliers)	Qualité	Échéance de la garantie	Devise de la garantie	Pays d'établissement de la contrepartie	Règlement et compensation
Fonds Strategic Income Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	$ 486	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds Total Return Bond Fund	Contrats de mise en pension	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	7 295	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	816	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds UK Corporate Bond Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	£ 537	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	451	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
	Contrats de prise en pension	Garantie en numéraire	Liquidités	58	S/O	S/O	USD	Canada	FED, bilatéral
Fonds US High Yield Bond Fund	Contrats de swap	Garantie en numéraire	Liquidités	$ 970	S/O	S/O	USD	Royaume-Uni	FED, bilatéral
	Contrats de mise en pension	Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation	Bons du Trésor	1 503	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	700	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral
Fonds US Short-Term Fund	Contrats de mise en pension	Billets du Trésor américain	Bons du Trésor	1 602	AAA	Plus d'un an	USD	États-Unis	FED, bilatéral

La juste valeur de la garantie correspondant aux Contrats de mise en pension comprend les intérêts courus.

Les Contrats cadres de transactions à terme couvrent une combinaison d'opérations par achat et revente dos-à-dos, d'opérations par vente et rachat dos-à-dos et d'autres opérations de financement non incluses plus haut. Le montant total des garanties reçues au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 pour toutes les opérations effectuées dans le cadre de ces Contrats est indiqué plus haut. Il n'est pas possible d'analyser séparément la garantie correspondant à chaque OFT.

Les Contrats ISDA recouvrent une combinaison de contrats de swap. Le montant total des garanties afférentes à ces contrats est indiqué plus haut.

Une partie des garanties indiquées se rapporte à des instruments financiers dérivés qui ne relèvent pas du champ de la ROFT.

(iv) Données concernant la réutilisation des garanties :
Les titres reçus à titre de garantie ne sont pas réutilisés au 31 décembre 2022 ou au 31 décembre 2021.

Les garanties reçues au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 étaient détenues au sein du réseau de dépositaires de State Street Bank and Trust.

(v) Garde des garanties données :
Les garanties nanties par les Fonds au 31 décembre 2022 et au 31 décembre 2021 sont détenues par les contreparties sur des comptes autres que des comptes regroupés ou séparés.

(c) Rendement/Frais
Les tableaux qui suivent présentent en détail les données sur les rendements et les frais pour chaque type d'OFT et de swap de rendement total pour les exercices clos le 31 décembre 2022 et le 31 décembre 2021. Les montants sont présentés dans la devise de référence des Fonds.

	31 décembre 2022							
	Contrats de mise en pension		Contrats de prise en pension		Opérations de financement par achat et revente dos-à-dos		Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	
Fonds	Rendement (en milliers)	Frais (en milliers)	Rendement (en milliers)	Frais (en milliers)	Rendement (en milliers)	Frais (en milliers)	Rendement (en milliers)	Frais (en milliers)
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	$ 1 057	$ 0	$ 818	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	33	0	29	0	0	0	0	0
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	195	0	401	(9 618)	0	0	0	0
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	271	0	0	(4)	0	0	0	(1)
Fonds Commodity Real Return Fund	327	0	0	(4 073)	0	(105)	0	(1 859)
Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	127	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Diversified Income Fund	15 705	0	3 046	(7)	0	0	0	0
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	1 358	0	60	0	0	0	0	0
Fonds Dynamic Bond Fund	8 310	0	43	0	0	0	0	0
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	€ 148	€ 0	€ 0	€ (6)	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Fonds Emerging Local Bond Fund	$ 141	$ (91)	$ 0	$ (6 016)	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0
Fonds Emerging Markets Bond Fund	240	0	0	(994)	0	0	0	(87)
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	888	0	137	(245)	0	0	0	0
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	33	0	0	(1)	0	0	0	0
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	324	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	12	0	0	0	0	0	0	0
Fonds PIMCO ESG Income Fund	514	0	0	0	0	0	0	0

Fonds	31 décembre 2022							
	Contrats de mise en pension		Contrats de prise en pension		Opérations de financement par achat et revente dos-à-dos		Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	
	Rendement (en milliers)	Frais (en milliers)	Rendement (en milliers)	Frais (en milliers)	Rendement (en milliers)	Frais (en milliers)	Rendement (en milliers)	Frais (en milliers)
Fonds Euro Bond Fund	€ 9	€ (36)	€ 14	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Fonds Euro Credit Fund	56	0	4	0	0	0	0	0
Fonds Euro Income Bond Fund	13	(5)	44	0	0	0	0	0
Fonds Euro Long Average Duration Fund	0	(1)	0	0	0	0	0	0
Fonds Euro Short-Term Fund	0	(41)	0	0	0	0	0	0
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund	0	(15)	2	0	0	0	0	0
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	0	(29)	4	0	0	0	0	0
Fonds Global Advantage Fund	$ 7	$ 0	$ 130	$ (189)	$ 0	$ 0	$ 0	$ (59)
Fonds Global Bond Fund	9 293	0	2 787	(1 200)	0	0	0	(31)
Fonds Global Bond ESG Fund	6 766	0	0	(8)	0	0	0	(1)
Fonds Global Bond Ex-US Fund	9	0	313	(50)	0	0	0	(12)
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	144	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Global High Yield Bond Fund	1 677	0	387	(93)	0	0	0	0
Fonds Global Investment Grade Credit Fund	325	0	0	(70)	0	0	0	(7)
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund	90	0	0	(830)	0	0	0	(234)
Fonds Global Low Duration Real Return Fund	28	0	0	(431)	0	(3)	0	(3 169)
Fonds Global Real Return Fund	108	0	58	(12 072)	0	0	0	(272)
Fonds Income Fund	93 412	(70)	1 457	0	0	0	0	(89)
Fonds Income Fund II	14	(1)	0	0	0	0	0	0
Fonds Inflation Multi-Asset Fund	1 101	0	0	(1)	0	0	0	(2)
Fonds Low Average Duration Fund	448	0	0	(959)	0	0	0	(199)
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	13	0	0	(150)	0	0	0	(45)
Fonds Low Duration Income Fund	1 256	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Low Duration Opportunities Fund	2 501	0	8	(102)	0	0	0	0
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	10	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Mortgage Opportunities Fund	126	0	0	(6 518)	0	0	0	(7)
Fonds StocksPLUS™ Fund	2 323	0	0	0	0	0	0	0
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	26	0	0	0	0	0	0	0
Fonds Strategic Income Fund	7	0	0	(6)	0	0	0	(1)
Fonds Total Return Bond Fund	3 214	0	20	(353)	0	0	0	(22)
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	174	0	0	0	0	0	0	0
Fonds UK Corporate Bond Fund	£ 145	£ 0	£ 0	£ (195)	£ 0	£ 0	£ 0	£ 0
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund	30	0	0	(86)	0	0	0	0
Fonds US High Yield Bond Fund	$ 1 076	$ 0	$ 29	$ (58)	$ 0	$ 0	$ 1	$ 0
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund	45	0	0	(8)	0	0	0	(9)
Fonds US Short-Term Fund	1 315	0	0	(683)	0	0	0	(391)

Fonds	31 décembre 2021							
	Contrats de mise en pension		Contrats de prise en pension		Opérations de financement par achat et revente dos-à-dos		Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos	
	Rendement (en milliers)	Frais (en milliers)	Rendement (en milliers)	Frais (en milliers)	Rendement (en milliers)	Frais (en milliers)	Rendement (en milliers)	Frais (en milliers)
Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund	$ 6	$ 0	$ 316	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0
Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund	0	0	4	0	0	0	0	0
Fonds PIMCO Capital Securities Fund	130	0	613	(1 519)	0	0	0	0
Fonds PIMCO Climate Bond Fund	13	(10)	0	0	0	0	0	0
Fonds Commodity Real Return Fund	5	0	2	(37)	0	0	12	0
Fonds Diversified Income Fund	164	(27)	1 615	0	0	0	0	0
Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund	13	0	51	0	0	0	0	0
Fonds Dynamic Bond Fund	41	0	35	(28)	0	0	12	0
Fonds Dynamic Multi-Asset Fund	€ 17	€ (2 979)	€ 13	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Fonds Emerging Local Bond Fund	$ 0	$ 0	$ 0	$ (5 769)	$ 0	$ 0	$ 0	$ 0
Fonds Emerging Markets Bond Fund	1	0	40	(371)	0	0	0	0
Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund	28	0	85	(800)	0	0	0	0
Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund	0	0	6	(1)	0	0	0	(1)
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	0	0	1	(10)	0	0	0	0
Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	1	0	0	0	0	0	0	0
Fonds PIMCO ESG Income Fund	0	0	0	(5)	0	0	0	0
Fonds Euro Bond Fund	€ 0	€ (275)	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0	€ 0
Fonds Euro Credit Fund	0	(46)	2	0	0	0	0	0
Fonds Euro Income Bond Fund	0	(99)	2	(36)	0	0	0	0

	31 décembre 2021															
	Contrats de mise en pension				Contrats de prise en pension				Opérations de financement par achat et revente dos-à-dos				Opérations de financement par vente et rachat dos-à-dos			
Fonds	Rendement (en milliers)		Frais (en milliers)		Rendement (en milliers)		Frais (en milliers)		Rendement (en milliers)		Frais (en milliers)		Rendement (en milliers)		Frais (en milliers)	
Fonds Euro Long Average Duration Fund	€	0	€	(13)	€	17	€	0	€	0	€	0	€	0	€	0
Fonds Euro Short-Term Fund		0		(205)		4		0		0		0		0		0
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund		0		(39)		0		0		0		0		0		0
Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund		0		(52)		14		0		0		0		0		0
Fonds Global Advantage Fund	$	0	$	0	$	63	$	(27)	$	0	$	0	$	2	$	0
Fonds Global Bond Fund		0		(2)		168		(33)		0		0		0		(20)
Fonds Global Bond ESG Fund		9		0		0		(5)		0		0		0		(2)
Fonds Global Bond Ex-US Fund		0		0		378		(40)		0		0		0		(1)
Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund		1		0		0		0		0		0		0		0
Fonds Global High Yield Bond Fund		5		0		154		0		0		0		8		0
Fonds Global Investment Grade Credit Fund		24		0		279		0		0		0		86		0
Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund		2		0		1		(4)		0		0		0		(5)
Fonds Global Low Duration Real Return Fund		0		0		0		0		0		(2)		0		(149)
Fonds Global Real Return Fund		1		0		16		(583)		0		0		0		(17)
Fonds Income Fund		760		(138)		751		(1 147)		0		0		131		0
Fonds Inflation Multi-Asset Fund		0		0		0		(5)		0		0		0		(1)
Fonds Low Average Duration Fund		6		0		0		0		0		0		0		0
Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund		1		0		0		0		0		0		0		(2)
Fonds Low Duration Income Fund		4		0		1		0		0		0		0		0
Fonds Low Duration Opportunities Fund		19		0		9		0		0		0		1		0
Fonds Mortgage Opportunities Fund		3		0		0		(133)		0		0		0		0
Fonds StocksPLUS™ Fund		449		(33)		0		0		0		0		0		0
Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund		1		0		0		0		0		0		0		0
Fonds Strategic Income Fund		0		0		0		(20)		0		0		0		(5)
Fonds Total Return Bond Fund		20		0		2		0		0		0		0		(4)
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund		1		0		0		0		0		0		0		0
Fonds UK Corporate Bond Fund	£	14	£	0	£	0	£	(32)	£	0	£	0	£	0	£	0
Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund		1		0		0		(26)		0		0		0		0
Fonds US High Yield Bond Fund		6		0		38		0		0		0		7		0
Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund		0		0		1		(7)		0		0		0		(19)
Fonds US Short-Term Fund		61		0		0		0		0		0		0		0

Tous les rendements des opérations sur instruments financiers dérivés OFT sont acquis au Fonds et ne font l'objet d'aucun accord de partage des rendements avec le Gestionnaire de la Société ni aucun autre tiers.

En ce qui concerne les swaps de rendement total, les frais de transaction ne peuvent être identifiés séparément. Pour ces investissements, les frais de transaction sont inclus dans le prix d'achat et de vente et font partie de la performance d'investissement brut de chaque Fonds. Les rendements sont identifiés comme les plus-values réalisées et la variation des plus-values latentes sur le contrat de swap au cours de l'exercice, qui sont incluses dans la Plus-value/(moins-value) nette réalisée sur les instruments financiers dérivés et la Variation nette de l'appréciation/(la dépréciation) latente sur les instruments financiers dérivés au Compte de résultat.

23. ÉVÉNEMENTS IMPORTANTS

Le 1er janvier 2022, le Fonds Diversified Income Fund a modifié la déclaration de dividendes et la politique de distribution de la Catégorie Administrations, qui sont passées de trimestrielles à mensuelles.

Le 20 janvier 2022, une souscription de 7 000 000 USD a été effectuée par le Gestionnaire sur le Fonds US Short-Term Fund.

En février 2022, la Russie a lancé une invasion de l'Ukraine, entraînant des sanctions imposées à diverses entités et personnes russes. Les Fonds peuvent investir dans des titres et instruments économiquement liés à la Russie. Ces investissements peuvent avoir été affectés négativement par les sanctions et les contre-sanctions imposées par la Russie, engendrant notamment une baisse de valeur et de liquidité. La baisse de liquidité des investissements liés à la Russie peut amener les Fonds à vendre des participations en portefeuille à un moment ou à un prix désavantageux ou à continuer à détenir des investissements liés à la Russie que les Fonds ne cherchent plus à détenir. PIMCO continuera à gérer activement ces positions dans l'intérêt des Fonds et de leurs actionnaires.

Le 13 avril 2022, le Fonds Inflation Strategy Fund a été renommé Fonds Inflation Multi-Asset Fund. À la même date, l'indice de référence a été modifié et est composé à 45 % de l'Indice Bloomberg Global Inflation Linked 1- 30yrs Index (couvert en USD), 15 % de l'Indice JPMorgan Emerging Local Markets Index Plus (non couvert en USD), 20 % de l'Indice Bloomberg Commodity Total Return Index, 10 % de l'Indice FTSE NAREIT Global Real Estate Developed Total Return Index (non couvert en USD), et 10 % de l'Indice Bloomberg Gold Subindex Total Return. Le taux des Frais de gestion a été modifié à 0,79 % pour les Catégories Administrations, Institutions, G Institutions et Investisseurs, à 0,96 % pour la Catégorie H Institutions et à 1,69 % pour les Catégories E et Détail.

Le 13 avril 2022, le Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund a modifié les Frais de gestion de la Catégorie E de 2,20 % à 1,89 %.

Le 25 avril 2022, un rachat de 11 500 000 USD a été effectué par le Gestionnaire sur le Fonds US Short-Term Fund.

Le 1er juillet 2022, le Fonds Global Libor Plus Bond Fund a été renommé Fonds Low Duration Opportunities Fund. À la même date, l'indice de référence des Fonds PIMCO Capital Securities Fund, PIMCO Credit Opportunities Bond Fund, Dynamic Bond Fund, Dynamic Multi-Asset Fund, Low Duration Opportunities Fund, Mortgage Opportunities Fund et PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund a été remplacé par l'Indice ICE BofA SOFR Overnight Rate Index.

Le 27 juillet 2022, les Fonds Diversified Income ESG Fund, Emerging Local Bond ESG Fund et Low Duration Opportunities ESG Fund ont été lancés.

Le 29 juillet 2022, l'indice de référence du Fonds Strategic Income Fund a été modifié et est composé à 75 % de l'Indice Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index et à 25 % de l'Indice MSCI ACWI High Dividend Yield Index. Le taux des Frais de gestion a été modifié à 0,79 % pour les Catégories Administrations, Institutions, G Institutions et Investisseurs, à 0,96 % pour la Catégorie H Institutions, à 0,93 % pour la Catégorie R et à 1,69 % pour les Catégories E, T et Détail.

À la date du présent rapport, les taux d'intérêt aux États-Unis et dans de nombreuses régions du monde, y compris dans certains pays européens, continuent d'augmenter. Pour lutter contre l'inflation, la Réserve fédérale des États-Unis a relevé ses taux d'intérêt à plusieurs reprises en 2022 et a indiqué qu'elle devrait continuer à relever ses taux d'intérêt en 2023. Ainsi, les Fonds sont actuellement confrontés à un niveau de risque accru associé à la hausse des taux d'intérêt et/ou des rendements obligataires.

Aucun autre événement important ne s'est produit au cours de l'exercice en dehors de ceux susmentionnés.

24. ÉVÉNEMENTS POSTÉRIEURS

Le 1er janvier 2023, la précédente exemption de Frais de gestion pour le Fonds Income Fund II a expiré. À la même date, l'exonération de commission pour le Fonds Low Duration Income Fund a pris fin et la commission de gestion a été abaissée de façon permanente.

Le 26 janvier 2023, Walkers Corporate Services (Ireland) Limited a remplacé State Street Fund Services (Ireland) Limited en qualité de Secrétaire général de la Société.

Le 20 mars 2023, UBS a accepté d'acheter Crédit Suisse. Étant donné qu'il s'agit d'un événement postérieur à la date de clôture, son impact après la fin de l'exercice n'a pas été pris en compte dans la comptabilisation et l'évaluation des actifs ou passifs des Fonds au 31 décembre 2022. Pour les placements de chaque Fonds auprès de Crédit Suisse, veuillez vous reporter au Tableau des investissements.

Le 6 avril 2023, une souscription de 5 000 000 USD a été effectuée par le Gestionnaire sur le Fonds US Short-Term Fund.

Aucun autre évènement important postérieur à la clôture de l'exercice ne s'est produit en dehors de ceux susmentionnés.

25. APPROBATION DES ÉTATS FINANCIERS

Les états financiers ont été approuvés le 25 avril 2023 par le Conseil d'administration.

Les Administrateurs présentent aux actionnaires les états financiers audités de la Société pour l'exercice clos le 31 décembre 2022.

RESPONSABILITÉS DES ADMINISTRATEURS

Les Administrateurs sont chargés de préparer le rapport annuel et les états financiers dans le respect du droit irlandais applicable et des Normes Comptables Généralement Admises en Irlande, notamment la norme FRS 102 (« FRS 102 »), « La norme de présentation de l'information financière applicable au Royaume-Uni et en République d'Irlande » émise par la Financial Reporting Council, la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014 et la Réglementation sur les OPCVM.

Dans le droit irlandais, les Administrateurs ne doivent approuver les états financiers que s'ils ont établi à leur satisfaction que ceux-ci donnent une image exacte et fidèle des actifs et passifs de la Société et de sa situation financière à la fin de l'exercice, ainsi que du bénéfice ou de la perte de la Société pour l'exercice.

En préparant les états financiers, les Administrateurs sont tenus de :

- choisir des méthodes comptables convenables, puis les appliquer avec cohérence ;
- apporter des jugements et estimations qui soient raisonnables et prudents ;
- indiquer si les états financiers ont été préparés conformément aux normes comptables applicables et identifier les normes en question, sous réserve que toute divergence importante avec ces normes soit décrite et expliquée dans les notes annexes aux états financiers ; et
- préparer les états financiers sur la base du principe de la continuité d'exploitation, à moins que ce soit inopportun de présumer que la société continue ses activités commerciales.

Les Administrateurs sont responsables de la tenue d'archives comptables adéquates et suffisantes à :

- justifier et expliquer correctement les opérations de la Société ;
- permettre, à tout moment, de déterminer avec une exactitude raisonnable les actifs, les passifs, la situation financière, le bénéfice ou la perte de la Société ; et
- permettre aux Administrateurs de s'assurer que les états financiers respectent la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014 et permettre l'audit de ces états financiers.

Ils sont également chargés d'assurer la protection des actifs de la Société, et donc de prendre les mesures nécessaires raisonnables pour la prévention et la détection des fraudes et autres irrégularités.

Les Administrateurs sont chargés du maintien et de l'intégrité de l'information sociale et financière figurant sur le site de la Société. La législation irlandaise en matière de préparation et de diffusion d'états financiers peut différer de celle d'autres juridictions.

DÉCLARATION DE CONFORMITÉ DES ADMINISTRATEURS

La Société a pour politique de se conformer à ses obligations pertinentes (définies dans la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014). Comme l'exige l'Article 225(2) de la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014, les Administrateurs reconnaissent qu'il leur incombe de faire en sorte que la Société se conforme aux obligations pertinentes. Les Administrateurs ont rédigé une déclaration de politique de conformité, telle que définie à l'Article 225(3)(a) de la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014, et une politique de conformité qui fait référence aux arrangements et structures en place qui, selon l'opinion des Administrateurs, sont conçus pour garantir le respect des obligations pertinentes de la Société, et ils ont procédé au cours de cet exercice à un examen des arrangements ou structures mis en place. Dans le cadre de l'exécution de leurs responsabilités en vertu de l'Article 225, les Administrateurs se sont fondés, entre autres, sur les services, conseils et/ou déclarations de tiers dont les Administrateurs croient qu'ils disposent des connaissances et de l'expérience requises pour garantir le respect des obligations pertinentes de la Société.

EMPLOYÉS

La Société n'avait aucun employé au cours des exercices clos le 31 décembre 2022 ou le 31 décembre 2021.

DÉCLARATION RELATIVE AUX INFORMATIONS D'AUDIT PERTINENTES

Les Administrateurs en fonction à la date du présent rapport ont confirmé, chacun, ce qui suit :

- À leur connaissance, il n'y a aucune information d'audit pertinente dont le commissaire aux comptes de la Société n'a pas connaissance ; et
- L'Administrateur a pris toutes les mesures qu'il ou elle devait prendre en sa qualité d'Administrateur pour s'informer de toute information d'audit pertinente et s'assurer que le commissaire aux comptes de la Société a connaissance de ces informations.

RÉSULTATS, ACTIVITÉS ET DÉVELOPPEMENTS ULTÉRIEURS

Les résultats des opérations et les dividendes déclarés sont exposés dans le Compte de résultat aux pages 92 à 110. Un rapport sur le rendement des placements des Fonds et un aperçu du portefeuille sont disponibles aux pages 6 à 66.

PRINCIPAUX RISQUES ET INCERTITUDES

Les détails relatifs aux objectifs et politiques de la gestion des risques financiers de la Société, et l'exposition de la Société aux risques du cours du marché, de change, de taux d'intérêt, de liquidité, de crédit et de contrepartie, sont divulgués dans la note 16 des Notes relatives aux États financiers.

ÉVÉNEMENTS IMPORTANTS

Une liste des événements importants touchant la Société au cours de l'exercice est divulguée à la Note 23.

ÉVÉNEMENTS POSTÉRIEURS À LA CLÔTURE DU BILAN

Une liste des événements postérieurs à la clôture du bilan touchant la Société après la fin de l'exercice est divulguée à la Note 24.

REGISTRES COMPTABLES

Les mesures prises par les Administrateurs pour garantir le respect des obligations de la Société de tenir les registres comptables adéquats consistent en l'utilisation de systèmes et procédures adéquats, et à employer des personnes compétentes. Les registres comptables sont tenus au niveau de State Street Fund Services (Ireland) Limited, 78 Sir John Rogerson's Quay, Dublin, D02 HD32, Irlande.

DÉCLARATION SUR LA GOUVERNANCE D'ENTREPRISE

La Société est soumise et se conforme à la législation irlandaise, qui comprend la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014, à la Réglementation des Communautés européennes (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières) de 2011 (S.I. N° 352 de 2011), tel que modifié (le « Règlement sur les OPCVM »), ainsi qu'aux Règles de cotation du Global Exchange Market (« GEM ») d'Euronext Dublin telles qu'elles s'appliquent aux Fonds de placement. Le Conseil d'administration (le « Conseil ») a évalué les mesures incluses dans le Code de gouvernance des Organismes de placement collectif et des Sociétés de gestion, dont l'application est volontaire, tel que publié par l'Irish Fund Industry Association en décembre 2011 (le « Code IFIA »). Le Conseil a adopté toutes les pratiques et procédures de gouvernance d'entreprise du Code IFIA.

Le Conseil a estimé que les mesures comprises dans le code IFIA étaient cohérentes avec ses pratiques et procédures de gouvernance d'entreprise pour l'exercice. Chaque prestataire de services auquel fait appel la Société est soumis à ses propres obligations en matière de gouvernance d'entreprise.

Processus de communication financière – description des principales caractéristiques

Le Conseil est chargé d'établir et de maintenir le contrôle interne approprié et les systèmes de gestion des risques de la Société dans le cadre du processus de communication financière. Ces systèmes sont destinés à gérer plutôt qu'à éliminer le risque de ne pas atteindre les objectifs de communication financière de la Société. Ils ne peuvent donner qu'une assurance raisonnable et non absolue contre les erreurs et les pertes significatives.

Le Conseil a défini des procédures afférentes au contrôle interne et aux systèmes de gestion des risques pour assurer sa supervision réelle du processus de communication financière. Ces procédures comprennent la nomination d'un Agent administratif, State Street Fund Administration Services (Ireland) Limited, pour la tenue des livres et des registres. L'Agent administratif est agréé et régi par la Banque centrale et doit respecter les règles imposées par cette dernière. L'Agent administratif est contractuellement tenu de préparer le rapport annuel comprenant les états financiers destinés à donner une image sincère et fidèle et les rapports semestriels et de les soumettre à l'examen et à l'approbation du Conseil.

Le Conseil évalue et étudie les questions importantes d'ordre comptable et relatives à la communication, si besoin est. Le Conseil examine et évalue périodiquement les procédures de comptabilisation et de communication de l'Agent administratif, ainsi que la performance, les qualifications et l'indépendance des Commissaires aux comptes externes. La responsabilité de l'Agent administratif est de nature opérationnelle en ce qui concerne ses contrôles internes du processus de communication financière et le rapport de l'Agent administratif au Conseil.

Évaluation du risque
Le Conseil a la responsabilité d'évaluer le risque d'irrégularités, d'origine frauduleuse ou erronée, dans la communication financière et de veiller à ce que les procédures soient en place pour l'identification en temps voulu des questions internes et externes susceptibles d'avoir un effet important sur la communication financière. Le Conseil a également mis en place des procédures visant à identifier les changements des principes et des recommandations comptables et à garantir que ces changements apparaissent correctement dans les états financiers de la Société.

Activités de contrôle
L'Agent administratif veille au maintien des structures de contrôle de gestion du risque sur la communication financière. Ces structures de contrôle consistent à répartir les responsabilités et à exécuter des activités spécifiques de contrôle visant à détecter ou à éviter le risque de lacune significative dans la communication financière en ce qui concerne les postes importants des états financiers et les notes annexes du rapport annuel de la Société. Parmi les exemples d'activités de contrôle exercées par l'Agent administratif, citons les procédures d'étude analytiques, les réconciliations et les contrôles automatisés des systèmes informatiques. La méthode de valorisation des titres et autres actifs lorsque les prix ne sont pas disponibles auprès d'une source extérieure indépendante est divulguée à la Note 3 des Notes relatives aux États financiers.

Information et communication
Les politiques de la Société et les instructions du Conseil afférentes à la communication financière sont actualisées et diffusées via les canaux appropriés, comme les messages électroniques, la correspondance et les réunions pour veiller à ce que toutes les obligations en matière d'information financière soient satisfaites avec exhaustivité et précision.

Suivi
Le Conseil reçoit régulièrement des présentations et étudie les rapports du Dépositaire, des Conseillers en investissement et de l'Agent administratif. Le Conseil a également mis en place un processus annuel qui assure que les mesures appropriées sont prises pour réfléchir aux et traiter les insuffisances identifiées, ainsi que les mesures recommandées par les Commissaires aux comptes indépendants.

Structure capitalistique
Personne ne détient, directement ou indirectement, un volume substantiel de titres de la Société. Personne ne dispose de droits particuliers de contrôle sur le capital social de la Société.

Les droits de vote ne font l'objet d'aucune restriction.

Pouvoirs des Administrateurs
En ce qui concerne la nomination et le remplacement des Administrateurs, la Société est régie par ses Statuts, les lois irlandaises comprenant la Loi sur les sociétés (Companies Acts) de 2014, la Réglementation sur les OPCVM, ainsi que les Règles de cotation du GEM d'Euronext Dublin applicables aux Fonds de placement. Les Statuts peuvent être modifiés sur résolution extraordinaire des actionnaires.

Le Conseil est chargé de gérer les affaires de la Société dans le respect des Statuts. Les Administrateurs peuvent déléguer certaines fonctions à l'Agent administratif et autres parties, sous la supervision et les directives des Administrateurs. Les Administrateurs ont délégué l'administration quotidienne de la Société à l'Agent administratif et les fonctions de gestion des investissements et de distribution aux Conseillers en investissement. Il en résulte qu'aucun Administrateur n'est exécutif.

Les Statuts stipulent que les Administrateurs peuvent exercer tous les pouvoirs de la Société pour emprunter de l'argent, hypothéquer ou nantir, tout ou partie de son entreprise et de ses biens immobiliers. Ils peuvent également déléguer ces pouvoirs aux Conseillers en investissement.

Les Administrateurs peuvent, à tout moment et périodiquement, suspendre à titre provisoire le calcul de la Valeur Nette d'Inventaire d'un Fonds particulier, ainsi que l'émission, le rachat et la conversion des actions dans un des cas suivants :

(a) pendant une période où un marché ou une Bourse de valeurs reconnue qui est le principal marché ou la principale Bourse de valeurs reconnue pour une part substantielle des investissements du Fonds est fermé (autre que pendant les jours fériés normaux ou pour la fermeture habituelle du week-end), ou pendant laquelle la négociation est limitée ou suspendue sur ce marché ou cette Bourse de valeurs ;
(b) pendant une période où survient un cas d'urgence qui a pour conséquence que la cession d'investissements qui représentent une part substantielle des actifs de la catégorie concernée par la Société n'est pas faisable ; ou pendant laquelle il est impossible de transférer des fonds pour acheter ou vendre des investissements à des taux de change normaux ; ou pendant laquelle il est impossible aux Administrateurs ou à leur délégué de déterminer correctement la valeur d'un actif du Fonds concerné ;

(c) pendant une interruption des moyens de communication qui servent habituellement à déterminer le prix de tout investissement du Fonds concerné ou les prix réels sur un marché ou une Bourse de valeurs reconnue ;

(d) si, pour une raison quelconque, les prix d'investissements d'une catégorie concernée ne peuvent être raisonnablement, rapidement ou précisément déterminés ;

(e) pendant une période où le versement de fonds qui seraient ou pourraient être impliqués dans la réalisation ou le paiement d'investissements d'une catégorie concernée ne peut, selon les Administrateurs, être effectué à des taux de change normaux ;

(f) pour liquider la Société ou clôturer un Fonds ; ou

(g) pour toute autre raison qui rend impossible la détermination correcte par leur délégué de la valeur d'une part substantielle des investissements de la Société ou d'un Fonds.

Un avis faisant part de cette suspension et un avis annonçant la fin de la suspension sera adressé immédiatement à la Banque centrale et à Euronext Dublin et les souscripteurs d'Actions ou les actionnaires qui demandent le rachat d'Actions seront informés au moment où ils déposent leur demande écrite de souscription ou de rachat. Toutes les mesures raisonnables seront prises, lorsque c'est possible, pour mettre fin à une période de suspension le plus rapidement possible.

Il est possible de transférer les actions nominatives sur demande écrite. Le document de transfert doit être accompagné d'un certificat du cessionnaire précisant qu'il n'achète pas les Actions pour le compte ou au bénéfice d'un Ressortissant des États-Unis. En cas de décès de l'un des codétenteurs, le ou les survivant(s) sera/seront la/les seule(s) personne(s) à laquelle/auxquelles l'Agent administratif reconnaît un droit de propriété sur ou un intérêt dans les Actions enregistrées aux noms de ces co-Actionnaires. Les Administrateurs peuvent refuser d'enregistrer un transfert s'ils savent ou pensent raisonnablement que, du fait de ce transfert, les Actions seraient la propriété réelle d'une personne en violation des limites imposées à la propriété par les Administrateurs ou que ce transfert aurait un effet juridique, réglementaire, pécuniaire, fiscal ou administratif défavorable important pour le Fonds concerné ou les actionnaires de manière générale.

Assemblées des actionnaires
L'Assemblée générale annuelle de la Société se tiendra normalement à Dublin, en septembre ou à toute autre date que les Administrateurs peuvent déterminer. L'avis de convocation à l'Assemblée générale annuelle au cours de laquelle les états financiers audités de la Société sont présentés (avec le rapport des Administrateurs et celui des Commissaires aux comptes de la Société) est adressé aux actionnaires à leur adresse inscrite au moins 21 jours francs avant la date fixée pour l'assemblée. D'autres assemblées générales peuvent être convoquées périodiquement par les Administrateurs selon la manière stipulée par le droit irlandais.

Chaque action donne droit à son détenteur à assister et à voter aux assemblées de la Société et du Fonds représenté par ces actions. Les sujets peuvent être décidés par une assemblée des actionnaires sur un vote à main levée sauf si un scrutin est requis par un actionnaire qui a le droit de voter à l'assemblée ou si le président de l'assemblée demande un scrutin. Chaque actionnaire dispose d'une voix lors d'un vote à main levée. Chaque action donne droit à son détenteur à une voix pour les sujets afférents à la Société qui sont soumis aux actionnaires par un scrutin.

Aucune catégorie d'actions ne confère à un détenteur de droits préférentiels ou de préemption ou de droits à participer aux bénéfices et aux dividendes d'une autre catégorie d'actions ou de droits de vote sur des sujets concernant uniquement une autre catégorie d'actions.

Une résolution visant à modifier les droits d'une catégorie nécessite l'approbation des trois quarts des détenteurs des actions représentées ou présentes et votant à une assemblée générale de la catégorie. Le quorum d'une assemblée générale de la catégorie convoquée pour statuer sur une modification des droits de la catégorie est de deux actionnaires au moins dont les détentions représentent un tiers des actions.

Chaque action autre que des actions de souscripteur donne droit à l'actionnaire à participer à parts égales, au prorata, aux dividendes et à l'actif net du Fonds dont les actions ont été émises, sauf si les dividendes ont été déclarés avant qu'il ne devienne actionnaire.

Les actions de souscripteur donnent droit aux actionnaires qui les détiennent d'assister et de voter aux assemblées générales de la Société mais ne leur donnent pas le droit de participer aux dividendes ou à l'actif net de la Société.

Composition et activités du Conseil et des comités
Le Conseil se compose actuellement de six Administrateurs, tous non exécutifs, dont trois d'entre eux sont indépendants des Conseillers en investissement. Les actionnaires peuvent démettre les Administrateurs sur simple résolution ordinaire, conformément aux procédures établies en vertu de la Loi irlandaise sur les sociétés (Companies Act) de 2014. Le Conseil se réunit au moins une fois par trimestre pendant chaque année civile. Le Conseil comporte un comité d'audit composé actuellement de trois Administrateurs indépendants qui se sont réunis quatre fois pendant l'exercice considéré.

OPÉRATIONS AVEC DES PERSONNES LIÉES

Les transactions effectuées avec le Gestionnaire ou le dépositaire d'un OPCVM et leurs délégués ou sous-délégués (à l'exclusion de tout sous-dépositaire désigné par un dépositaire et qui n'est pas une société du groupe) et toute entité associée ou société appartenant au même groupe que ce Gestionnaire, dépositaire, délégué ou sous-délégué (« personnes liées ») doivent être effectuées comme si elles étaient réalisées dans des conditions commerciales normales, négociées dans des conditions de pleine concurrence et seulement lorsqu'elles sont dans l'intérêt des actionnaires. Les Administrateurs sont convaincus que des arrangements (comme en font foi les procédures écrites) sont en place pour garantir que les opérations avec des personnes liées sont effectuées comme décrit plus haut et que les conditions y afférentes ont été respectées au cours de l'exercice.

ADMINISTRATEURS

Les Administrateurs qui étaient en fonction pendant l'exercice clos le 31 décembre 2022 sont :

V. Mangala Ananthanarayanan – nommée le 30 juin 2016
Ryan P. Blute – nommé le 30 mai 2014
John Bruton – nommé le 28 février 2018
Craig A. Dawson – nommé le 6 mai 2009
David M. Kennedy – nommé le 16 avril 1999
Frances Ruane – nommée le 28 février 2018

Les Statuts ne prévoient pas de retrait des Administrateurs par rotation.

SECRÉTAIRE

State Street Fund Services (Ireland) Limited a exercé les fonctions de Secrétaire pour l'exercice clos le 31 décembre 2022.

INTÉRÊTS DES ADMINISTRATEURS ET DU SECRÉTAIRE EN ACTIONS ET CONTRATS

Au 31 décembre 2022, V. Mangala Ananthanarayanan détenait 8 187,77 (31 décembre 2021 : 8 187,77) actions du Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 5 319,15 (31 décembre 2021 : néant) actions du Fonds PIMCO Capital Securities Fund, 8 757,87 (31 décembre 2021 : 8 757,87) actions du Fonds Dynamic Multi-Asset Fund, 3 619,69 (31 décembre 2021 : néant) actions du Fonds Global Bond Fund et 27 543,65 (31 décembre 2021 : 22 028,26) actions du Fonds Income Fund, tous des Fonds de la Société.

Au 31 décembre 2022, Ryan P. Blute détenait 5 387,93 (31 décembre 2021 : 5 387,93) actions du Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund, 24 131,27 (31 décembre 2021 : 24 131,27) actions du Fonds Low Average Duration Fund et 82 494,63 (31 décembre 2021 : 72 957,20) actions du Fonds Low Duration Income Fund, tous des Fonds de la Société.

Au 31 décembre 2022, Craig A. Dawson détenait 18 118,23 (31 décembre 2021 : 18 118,23) actions du Fonds PIMCO Capital Securities Fund, 97 370,98 (31 décembre 2021 : 97 370,98) actions du Fonds Low Duration Income Fund et 92 850,51 (31 décembre 2021 : 92 850,51) actions du Fonds Low Duration Opportunities Fund, qui sont tous des Fonds de la Société.

Au 31 décembre 2022, David M. Kennedy détenait 4 449,56 (31 décembre 2021 : 4 729,05) actions du Fonds Emerging Markets Bond Fund et 16 786,79 (31 décembre 2021 : 16 786,79) actions du Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund, tous deux Fonds de la Société.

Le Secrétaire ne détenait pas d'actions de la Société au cours des exercices clos les 31 décembre 2022 ou 31 décembre 2021.

Aucun Administrateur n'a de contrat de services avec la Société.

CONSEILLERS JURIDIQUES EN DROIT IRLANDAIS

Dillon Eustace LLP fut le Conseiller juridique (en matière de droit irlandais) de la Société durant l'exercice clos le 31 décembre 2022.

COMMISSAIRES AUX COMPTES INDÉPENDANTS

Les Commissaires aux comptes indépendants, PricewaterhouseCoopers, ont exprimé leur volonté de continuer d'exercer leurs fonctions conformément à l'Article 383 de la Loi de 2014 sur les sociétés.

Au nom du Conseil d'administration

Administrateur : Craig A. Dawson

Administrateur : David M. Kennedy

Date : 25 avril 2023

Rapport des commissaires aux comptes indépendants aux membres de PIMCO Funds: Global Investors Series plc

The French version of the audit report represents a translation, for information purposes, of the original Auditor's report issued in the English language. In the event that the English version of this report and a translation of it into a language other than English differ, the English version shall prevail.

Rapport de l'audit des états financiers

Opinion

À notre avis, les états financiers de PIMCO Funds: Global Investors Series plc :

- donnent une image fidèle et exacte des actifs, des passifs et de la situation financière de la Société et des Fonds au 31 décembre 2022 et de leurs résultats pour l'exercice ainsi clos ;
- ont été correctement préparés en vertu des Normes Comptables Généralement Admises en Irlande (normes comptables émises par le Financial Reporting Council du Royaume-Uni, y compris la norme FRS 102 « La norme de présentation de l'information financière applicable au Royaume-Uni et en République d'Irlande » et le droit irlandais) ; et
- ont été dressés correctement conformément aux exigences de la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014 et à la Réglementation 2011 (telle que modifiée) des Communautés européennes (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières).

Nous avons procédé à l'audit des états financiers, inclus dans le Rapport annuel, qui sont composés :

- du Bilan au 31 décembre 2022 ;
- du Compte de résultat de l'exercice clos à cette date ;
- de l'État de l'évolution des actifs nets de l'exercice clos à cette date ;
- du Tableau des investissements de chacun des Fonds au 31 décembre 2022 ; et
- des notes relatives aux états financiers de la Société et de chacun de ses Fonds, qui comprennent une description des principales règles comptables.

Fondements de l'opinion

Nous avons mené notre audit conformément aux Normes Internationales d'Audit (Irlande) (« ISA (Irlande) ») et le droit applicable.

Nos responsabilités en vertu des Normes Internationales d'Audit (Irlande) sont décrites plus en détails dans les responsabilités des Commissaires aux comptes pour l'audit de la section de notre rapport consacrée aux états financiers. Nous estimons que les éléments probants d'audit que nous avons obtenus sont suffisants et adéquats pour les fondements de notre opinion.

Indépendance

Nous sommes restés indépendants de la Société conformément aux exigences éthiques pertinentes pour notre audit des états financiers en Irlande, et qui comprend la Norme éthique de l'IAASA telle qu'applicable aux entités cotées, et nous avons assumé nos autres responsabilités éthiques conformément à ces exigences.

Notre approche d'audit

Aperçu

Seuil de signification

- Seuil de signification global : 50 points de base (2021 : 50 points de base de la Valeur Nette d'Inventaire (« VNI ») au 31 décembre 2022 (2021 : 31 décembre 2021) pour chacun des Fonds de la Société.
- Seuil de signification de la performance : 75 % du seuil de signification global.

Portée de l'audit

- La Société est une société à responsabilité limitée, à capital variable, et engage PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (le « Gestionnaire ») pour gérer certaines obligations et responsabilités concernant la gestion quotidienne de la Société. Nous avons adapté la portée de notre audit pour prendre en compte les types d'investissements au sein des Fonds, l'implication de tiers dont il est fait référence [ci-dessous/au verso], les processus et contrôles comptables et le secteur dans lequel la Société exerce ses activités. Nous analysons chacun des Fonds au niveau individuel.

Questions clés de l'audit

- Évaluation des actifs et des passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat.
- Existence des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat.

La portée de notre audit

Dans le cadre de la conception de notre audit, nous avons identifié le seuil de signification et évalué les risques d'erreur significative dans les états financiers. En particulier, nous nous sommes penchés sur les sections dans lesquels les administrateurs posent des jugements subjectifs, par exemple la sélection de sources de détermination des prix pour évaluer le portefeuille d'investissement. Comme dans tous nos audits, nous avons également abordé le risque de contournement par la direction des contrôles internes, notamment une évaluation permettant de déterminer s'il existait des preuves de parti pris de la part des administrateurs qui représentait un risque d'erreur significative en raison d'une fraude.

Questions clés de l'audit

Les questions clés de l'audit sont ces questions qui, selon le jugement professionnel des commissaires aux comptes, étaient les plus importantes dans l'audit des états financiers de la période actuelle et comprennent les risques évalués les plus importants d'erreurs significatives (en raison ou non d'une fraude) identifiés par les commissaires aux comptes, y compris ceux ayant l'effet le plus conséquent sur la stratégie générale d'audit, l'attribution de ressources d'audit et l'orientation des efforts de l'équipe de mission. Ces questions, et tout commentaire fait sur les résultats de nos procédures à ce sujet, ont été abordées dans le contexte de notre audit des états financiers dans leur ensemble, et pour former notre opinion, et nous ne fournissons pas un avis distinct sur ces sujets. Il ne s'agit pas d'une liste exhaustive de tous les risques identifiés dans le cadre de notre audit.

Question clé de l'audit	***Comment notre audit aborde les questions clés de l'audit***
Évaluation des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat Veuillez vous reporter au Tableau des investissements de chacun des Fonds, aux principales méthodes comptables énoncées à la note 2 et à la section Investissements à la juste valeur et hiérarchie de la juste valeur figurant à la note 3. Les actifs et les passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat compris dans le Bilan des Fonds au 31 décembre 2022 sont évalués à la juste valeur conformément aux Normes Comptables Généralement Admises en Irlande. Nous avons considéré que l'évaluation des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat était une question clé de l'audit, car elle représente le principal élément des états financiers.	Au 31 décembre 2022, nous avons testé la valorisation des valeurs mobilières, des dépôts détenus auprès d'établissements de crédit et la juste valeur des titres vendus à découvert auprès de fournisseurs tiers, le cas échéant. En l'absence de sources de fournisseurs tiers disponibles pour certains postes de niveau 1 ou niveau 2, nous avons réalisé des procédures de test alternatives, notamment en obtenant la confirmation de la cotation de courtiers ou le soutien de la direction en matière de tarification. Nous avons testé la juste valeur des valeurs mobilières présentées comme des investissements appartenant au niveau 3 en examinant les méthodes et les données utilisées par la direction pour développer une estimation de la juste valeur. Pour certaines positions de niveau 3, présentées dans le Tableau des investissements du Fonds Emerging Local Bond Fund, nous avons testé la juste valeur des titres qui avaient été évalués par la direction en faisant appel à notre expert en valorisation interne pour élaborer une estimation indépendante de la juste valeur. Nous avons comparé les résultats de notre valorisation indépendante avec celle de la direction afin d'en tirer des conclusions sur le caractère raisonnable des estimations de la direction concernant la juste valeur. Les fonds d'investissement comprennent les Fonds négociés en bourse et les Organismes de placement collectif. Nous avons testé la valorisation des Fonds négociés en bourse auprès de fournisseurs tiers. Concernant les Organismes de placement collectif, nous avons convenu de la juste valeur selon une confirmation indépendante de l'agent de transfert sous-jacent. Nous avons testé la juste valeur des contrats de mise en pension en validant la juste valeur aux déclarations de contrepartie. Nous avons testé la valorisation des instruments financiers dérivés en faisant appel à notre expert en valorisation interne afin de développer une estimation indépendante de la juste valeur et d'en tirer des conclusions sur le caractère raisonnable des estimations de la direction concernant la juste valeur ou en obtenant les prix auprès de fournisseurs tiers, le cas échéant. Ces procédures n'ont identifié aucune erreur significative.
Existence des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat Veuillez vous reporter au Tableau des investissements de chacun des Fonds, aux principales méthodes comptables énoncées à la note 2 et à la section Investissements à la juste valeur et hiérarchie de la juste valeur figurant à la note 3. Les actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat compris dans le Bilan de chaque Fonds sont détenus au nom de chaque Fonds au 31 décembre 2022. Nous avons considéré que l'existence des actifs et passifs financiers à la juste valeur par le biais du compte de résultat était une question clé de l'audit, car elle représente le principal élément des états financiers.	Nous avons obtenu une confirmation indépendante du Dépositaire ou de contreparties indépendantes concernant les valeurs mobilières et les dépôts détenus auprès d'établissements de crédit au 31 décembre 2022. Nous avons rapproché les avoirs selon les confirmations des placements détenus conformément aux livres de compte et un échantillon d'éléments de rapprochement notés a été testé sur la base des pièces justificatives. Pour la juste valeur des titres vendus à découvert, nous avons obtenu des confirmations indépendantes de la part des contreparties. Les fonds d'investissement comprennent les Fonds négociés en bourse et les Organismes de placement collectif. Pour les Fonds négociés en bourse, nous avons obtenu une confirmation indépendante de la part du Dépositaire. Concernant les Organismes de placement collectif, nous avons obtenu une confirmation indépendante de l'agent de transfert sous-jacent. Pour les contrats de mise en pension, nous avons obtenu des confirmations indépendantes de la part des contreparties. S'agissant des instruments financiers dérivés, nous avons obtenu des confirmations indépendantes de la part des contreparties, le cas échéant. En l'absence de confirmation reçue de la part de la contrepartie indépendante, nous avons mis en œuvre des procédures de test alternatives sur certaines positions. Pour les contrats de change à terme, nous avons, dans la mesure du possible, effectué des liquidations sur les relevés bancaires. Par ailleurs, lorsqu'une position est importante et que la date d'échéance est postérieure à la date d'approbation de l'audit, nous l'avons confirmée de manière indépendante auprès des contreparties. Ces procédures n'ont identifié aucune erreur significative.

Comment nous avons adapté la portée de l'audit

Nous avons adapté la portée de notre audit pour nous assurer que nous avions fourni assez de travail pour donner un avis sur les états financiers dans leur ensemble, en prenant en compte la structure de la Société, les processus et contrôles comptables et le secteur dans lequel la société exerce ses activités.

Au 31 décembre 2022, 56 Fonds sont en opération. Le Bilan, le Compte de résultat et l'État de l'évolution des actifs nets sont un cumul des positions et des résultats des Fonds.

Les administrateurs contrôlent les affaires de la Société et sont responsables de la politique d'investissement globale qu'ils déterminent. La Société fait appel à un Gestionnaire pour gérer certaines obligations et responsabilités concernant la gestion quotidienne de la Société. Le Gestionnaire a délégué certaines responsabilités aux Conseillers en investissement et à State Street Fund Services (Ireland) Limited (l'« Agent administratif »). Les états financiers, qui restent la responsabilité des administrateurs, sont préparés pour leur compte par l'Agent administratif. La Société a nommé State Street Custodial Services (Ireland) Limited (le « Dépositaire ») pour agir en tant que Dépositaire des actifs de la Société. En établissant l'approche globale de notre audit, nous avons évalué le risque d'erreurs significatives au niveau d'un Fonds, en prenant en compte la nature, la probabilité et l'ampleur éventuelle de toute erreur. Dans le cadre de notre évaluation du risque, nous avons pris en compte l'interaction de la Société avec l'Agent administratif, et nous avons évalué l'environnement de contrôle en place chez l'Agent administratif.

Seuil de signification

La portée de notre audit a été influencée par notre application du seuil de signification. Nous établissons des seuils quantitatifs pour déterminer le seuil de signification. De même que les considérations qualitatives, ceux-ci nous ont aidés à déterminer la portée de notre audit, ainsi que la nature, le calendrier et l'étendue de nos procédures d'audit sur les postes individuels et les informations fournies dans les états financiers et de l'évaluation de l'effet de déclarations inexactes, individuellement et de façon globale, sur les états financiers dans leur ensemble.

Selon notre jugement professionnel, nous avons déterminé le seuil de signification pour les états financiers de chacun des Fonds de la Société comme suit :

Le seuil de signification global et comment nous l'avons déterminé	50 points de base (2021 : 50 points de base de la Valeur Nette d'Inventaire (« VNI ») au 31 décembre 2022 (2021 : 31 décembre 2021) pour chacun des Fonds de la Société.
Logique derrière le choix de l'indice de référence	Nous avons appliqué cet indice de référence, car l'objectif principal de la Société est de fournir aux investisseurs un rendement total au niveau du Fonds, en tenant compte du rendement du capital et des revenus.

Nous utilisons le seuil de signification de la performance pour réduire à un niveau suffisamment faible la probabilité que l'ensemble des erreurs non corrigées et non détectées dépasse le seuil de signification global. Plus précisément, nous utilisons le seuil de signification de la performance pour déterminer la portée de notre audit, ainsi que la nature et l'étendue de nos tests sur les soldes de comptes, les catégories de transactions et les informations à fournir, par exemple en déterminant la taille des échantillons. Le seuil de signification de la performance s'élevait à 75 % du seuil de signification global.

Pour déterminer le seuil de signification de la performance, nous avons tenu compte d'un certain nombre de facteurs (l'historique des erreurs, l'évaluation des risques et le risque d'agrégation, ainsi que l'efficacité des contrôles) et avons conclu qu'un montant situé dans la partie supérieure de notre fourchette normale était approprié.

Nous avons convenu avec le Conseil d'administration que nous les informerions de toute erreur identifiée pendant notre audit supérieure à 10 % du seuil de signification global, à des fins de différences d'impact de la VNI par action (2021 : 10 % du seuil de signification global, à des fins de différences d'impact de la VNI par action), ainsi que de toute erreur inférieure à ce montant qui, selon nous, justifierait un signalement pour des raisons qualitatives.

Conclusions concernant le principe de continuité d'exploitation

Notre jugement sur l'évaluation faite par les administrateurs de la capacité de la Société et des Fonds à continuer à adopter une comptabilité sur une base de continuité d'exploitation inclut les étapes suivantes :

- Obtenir une compréhension des indicateurs clés qui sont surveillés en ce qui concerne l'hypothèse de la continuité de l'exploitation et les futurs plans de la direction pour les Fonds sur la période de continuité de l'exploitation (d'une durée de 12 mois à compter de la date d'approbation des états financiers) ;
- Réviser les procès-verbaux des réunions du Conseil d'administration disponibles au cours de la période sous audit et ceux disponibles jusqu'à la date du présent rapport ;
- Prendre en compte l'activité d'investissement en fin d'exercice telle qu'elle est enregistrée dans les registres comptables sous-jacents ;
- S'enquérir auprès de la direction de tous les projets de rachats importants dont elle a été informée ;
- Prendre en considération les techniques de gestion du risque de liquidité qui sont mises à disposition de la Société et des Fonds.

Sur la base du travail que nous avons effectué, nous n'avons identifié aucune incertitude importante concernant des événements ou des conditions qui, individuellement ou collectivement, pourraient mettre en doute, de façon importante, la capacité de la Société et des Fonds à continuer selon le principe de la continuité d'exploitation pour une période d'au moins douze mois à compter de la date à laquelle les états financiers peuvent être émis.

Au cours de notre audit des états financiers, nous avons conclu que l'utilisation par les administrateurs d'une base de continuité d'exploitation dans la préparation des états financiers était appropriée.

Cependant, comme il n'est pas possible de prédire tous les événements ou conditions futurs, cette conclusion n'est une garantie de la capacité de la Société et des Fonds à poursuivre leurs activités selon le principe de continuité d'exploitation.

Nos responsabilités et les responsabilités des administrateurs s'agissant de la continuité d'exploitation sont décrites dans les sections pertinentes du présent rapport.

Rapport concernant d'autres informations

Les autres informations comprennent toutes les informations contenues dans le Rapport annuel autres que les états financiers et notre rapport des commissaires aux comptes à ce sujet. Les administrateurs sont responsables des autres informations. Notre avis concernant les états financiers ne couvre pas les autres informations et, par conséquent, nous de formulons pas d'opinion d'audit ou, sauf indication contraire explicite dans le présent rapport, toute forme d'assurance les concernant. En relation avec notre audit des états financiers, notre responsabilité est de lire les autres informations et, ainsi faisant, de considérer si les autres informations sont matériellement contradictoires avec les états financiers ou les connaissances acquises lors de l'audit, ou semblent par ailleurs comporter des erreurs significatives. Si nous identifions une erreur significative ou un écart important apparent, nous sommes tenus de mettre en œuvre des procédures visant à conclure s'il existe une erreur significative dans les états financiers ou les autres informations. Si, sur la base du travail mis en œuvre, nous avons conclu qu'il existe une erreur significative dans ces autres informations, nous sommes tenus de le signaler. Nous n'avons rien à déclarer sur la base de ces responsabilités.

Concernant le Rapport des Administrateurs, nous avons également vérifié que les divulgations exigées par la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014 ont bien été incluses.

Sur la base des responsabilités décrites ci-dessus et du travail entrepris au cours de notre mission d'audit, les ISA (Irlande) et la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014 exigent que nous communiquions certains avis et questions tels que décrits ci-dessous :

- Selon nous, en fonction des travaux entrepris dans le cours de l'audit, les informations fournies dans le Rapport des Administrateurs pour l'exercice clos le 31 décembre 2022 sont conformes aux états financiers et ont été préparées conformément aux exigences légales applicables.
- Sur la foi de notre connaissance et de notre compréhension de la Société et de son environnement, acquises dans le cadre de notre audit, nous n'avons identifié aucune erreur significative dans le Rapport des Administrateurs.

Responsabilités afférentes aux états financiers et à l'audit

Responsabilités des administrateurs afférentes aux états financiers

Comme indiqué plus en détail dans les Responsabilités des Administrateurs, les administrateurs sont tenus de préparer des états financiers conformément au cadre applicable et de s'assurer que ceux-ci donnent une image exacte et fidèle.

Les administrateurs sont également responsables des contrôles internes qu'ils jugent nécessaires pour permettre la préparation d'états financiers qui sont exempts d'erreurs significatives, que celles-ci soient dues à la fraude ou à l'erreur.

Dans la préparation des états financiers, les administrateurs sont responsables de l'évaluation de la capacité de la Société et des Fonds à poursuivre leurs activités selon le principe de continuité d'exploitation, divulguant le cas échéant, des observations relatives à la continuité d'exploitation et appliquant une comptabilité sur la base de continuité d'exploitation sauf si les administrateurs soit ont l'intention de liquider la Société ou de cesser l'exploitation, ou n'ont pas d'autres choix réalistes que de le faire.

Responsabilités des commissaires aux comptes à l'égard de l'audit des états financiers

Nos objectifs sont d'obtenir une assurance raisonnable en ce qui concerne les états financiers dans leur ensemble, qu'ils soient exempts d'erreurs significatives, en raison de fraude ou d'erreur, et de publier un rapport des commissaires aux comptes qui comprend notre opinion. Une assurance raisonnable est un niveau élevé d'assurance, mais n'est pas une garantie qu'un audit effectué conformément aux ISA (Irlande) détectera toujours une erreur significative lorsque celle-ci existe. Les erreurs peuvent résulter d'une fraude ou d'une erreur et sont considérées comme significatives si, individuellement ou dans leur ensemble, elles pouvaient raisonnablement avoir une influence sur les décisions économiques des utilisateurs prises sur la base de ces états financiers.

Les irrégularités, y compris les fraudes, sont des cas de non-respect des lois et règlements. Nous concevons des procédures conformes à nos responsabilités, décrites ci-dessus, afin de détecter les erreurs significatives concernant les irrégularités, y compris les fraudes. La mesure dans laquelle nos procédures sont capables de détecter les irrégularités, y compris les fraudes, est détaillée ci-dessous.

Sur la base de notre compréhension de la Société et du secteur, nous avons identifié que les principaux risques de non-conformité aux lois et réglementations en matière d'irrégularités, y compris de fraudes, sont des cas de non-conformité aux lois et réglementations. Nous concevons des procédures conformes à nos responsabilités, décrites ci-dessus, afin de détecter les erreurs significatives concernant les irrégularités, y compris les fraudes. La mesure dans laquelle nos procédures sont capables de détecter les irrégularités, y compris les fraudes, est détaillée ci-dessous, et nous avons examiné la mesure dans laquelle la non-conformité pourrait avoir un effet significatif sur les états financiers. Nous avons également pris en compte les lois et règlements qui ont une incidence directe sur la préparation des états financiers, tels que la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014 et la Réglementation de 2011 (telle que modifiée) des Communautés européennes (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières). Nous avons évalué les éventuelles motivations et les possibilités de manipulation frauduleuse des états financiers de la part de la direction (y compris le risque de contournement des contrôles), et avons déterminé que les principaux risques étaient liés au risque de contournement des contrôles par la direction.

Les procédures d'audit appliquées par l'équipe de mission comprenaient :

- Enquêter auprès de la direction afin d'identifier tout cas de non-respect des lois et réglementations ;
- Identifier et tester les entrées de journal qui répondent à nos critères spécifiques basés sur les risques ;
- Tester les estimations comptables ainsi que les jugements et les risques potentiels de biais de la direction ;
- Concevoir des procédures d'audit pour intégrer le caractère imprévisible de la nature, du calendrier ou de l'étendue de nos tests ; et
- Examiner le procès-verbal des réunions du Conseil d'administration.

Les procédures d'audit décrites ci-dessus comportent des limites inhérentes. Nous sommes moins susceptibles de détecter des cas de non-conformité aux lois et règlements qui ne sont pas étroitement liés aux événements et transactions figurant dans les états financiers. De plus, le risque de non-détection d'une erreur significative résultant d'une fraude est plus élevé que pour une anomalie découlant d'une erreur, car la fraude peut impliquer une dissimulation délibérée, par exemple, par des faux ou de fausses déclarations délibérées, ou par collusion.

Nos tests d'audit peuvent porter sur la totalité de certaines transactions et de certains soldes et peuvent utiliser des techniques de vérification des données. Toutefois, il s'agit généralement de sélectionner un nombre limité d'éléments à tester, plutôt que de tester des ensembles complets. Pour les tests, nous cherchons souvent à cibler des éléments particuliers en fonction de leur taille ou de leurs caractéristiques de risque. Dans d'autres cas, nous vérifions un échantillon pour en tirer une conclusion sur l'ensemble des données dont cet échantillon provient.

Une description plus détaillée de nos responsabilités à l'égard de l'audit des états financiers se trouve sur le site de l'IAASA à l'adresse suivante :

https://www.iaasa.ie/getmedia/b2389013-1cf6-458b-9b8f-a98202dc9c3a/Description_of_auditors_responsibilities_for_audit.pdf.

Cette description fait partie de notre rapport des commissaires aux comptes indépendants.

Usage du présent rapport

Le présent rapport, y compris les opinions, a été préparé exclusivement pour les membres de la Société en tant qu'organe conformément à l'Article 391 de la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014, et n'est destiné à aucune autre fin. En donnant ces opinions, nous n'acceptons et n'assumons de responsabilité à aucune autre fin et envers aucune autre personne à laquelle le présent rapport est présenté ou entre les mains de laquelle il pourrait tomber, sauf accord exprès par notre consentement écrit préalable.

Autres exigences

Avis concernant d'autres questions en vertu de la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014

- Nous avons obtenu toutes les informations et explications que nous considérons comme étant nécessaires aux fins de notre audit.
- À notre avis, les registres comptables de la Société étaient suffisants pour permettre l'audit facile et correct des états financiers.
- Les états financiers concordent avec les registres comptables.

Rapport d'exception en vertu de la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014

Rémunération et transactions des Administrateurs

En vertu de la Loi sur les sociétés (Companies Act) de 2014, nous sommes tenus de vous présenter un rapport si, à notre avis, les informations relatives à la rémunération et aux transactions des administrateurs visées dans les articles 305 à 312 de cette Loi n'ont pas été communiquées. Nous n'avons aucune exception à signaler dans le cadre de cette responsabilité.

Mary Ruane
pour et au nom de PricewaterhouseCoopers
Cabinet d'expertise-comptable et commissaire aux comptes
Dublin
26 avril 2023

Rapport du Dépositaire

Nous avons étudié la conduite de PIMCO Funds: Global Investors Series plc (la « Société ») pour l'exercice clos le 31 décembre 2022 en notre qualité de Dépositaire de la Société.

Ce rapport, y compris l'opinion, a été préparé à la seule intention des actionnaires de la Société, pris en tant qu'organe, conformément à la Réglementation 34, (1), (3) et (4) de la Section 5 de la Réglementation 2011 (telle que modifiée) (« Réglementation sur les OPCVM ») des Communautés européennes (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières), à l'exclusion de toute autre fin. En donnant cette opinion, nous n'acceptons ni n'assumons de responsabilité à aucune autre fin et envers aucune autre personne à laquelle le présent rapport est présenté.

RESPONSABILITÉS DU DÉPOSITAIRE

Nos fonctions et responsabilités sont décrites dans la Règlementation 34, (1), (3) et (4) de la Section 5 de la Réglementation sur les OPCVM. Elles comprennent notamment d'enquêter sur la conduite de la Société au cours de chaque exercice et d'en rendre compte aux actionnaires.

Notre rapport indiquera si, à notre avis, la Société a été gérée durant cette période conformément aux dispositions de la constitution de la Société (la « Constitution ») et de la Réglementation sur les OPCVM. Il incombe globalement à la Société de se conformer à ces dispositions. Si la Société ne s'y est pas conformée, nous devons, en tant que Dépositaire, en indiquer les raisons, et décrire les mesures que nous avons prises pour remédier à la situation.

FONDEMENTS DE L'OPINION DU DÉPOSITAIRE

Le Dépositaire procède aux investigations qu'il juge raisonnablement nécessaires en vue de se conformer à ses obligations, tel que décrit dans la Réglementation 34, (1), (3) et (4) de la Section 5 de la Réglementation sur les OPCVM, et de s'assurer que, à tous égards importants, la Société a été gérée (i) en conformité avec les limitations imposées à son pouvoir relatif à l'investissement et à sa capacité d'emprunt par les dispositions de la Constitution et de la Réglementation sur les OPCVM et (ii) par ailleurs en conformité avec la Constitution de la Société et la réglementation pertinente.

OPINION

À notre avis, la Société a été gérée durant la période comptable, à tous égards importants :

(i) conformément aux limitations imposées au pouvoir de la Société relatif à l'investissement et à sa capacité d'emprunt par sa Constitution, par la Réglementation sur les OPCVM et la Réglementation de 2019 (Organismes de placement collectif en valeurs mobilières) prise en application de l'article 48(1) de la Loi de 2013 de la Banque centrale (supervision et exécution) (Central Bank (Supervision and Enforcement) Act) (« la Réglementation sur les OPCVM de la Banque centrale ») ; et

(ii) par ailleurs conformément aux dispositions de la Constitution, de la Réglementation OPCVM et de la Réglementation sur les OPCVM de la Banque centrale.

State Street Custodial Services (Ireland) Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin D02 HD32
Irlande

Date : 25 avril 2023

Éléments fournis concernant les rémunérations

(Non audités)

PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited (le « Gestionnaire »), conformément à ses obligations en vertu de la Directive 2009/65/CE, telle que modifiée (la « Directive OPCVM ») est tenu d'avoir des politiques et pratiques de rémunération en place pour les catégories de personnel, dont la haute direction, les preneurs de risques, les fonctions de contrôle et tous les salariés percevant une rémunération qui les classe dans la même fourchette que les membres de la haute direction et les preneurs de risque, dont les activités professionnelles ont une incidence substantielle sur les profils de risque du Gestionnaire ou de tout Organisme de placement collectif en valeurs mobilières (« OPCVM ») géré, qui respectent et promeuvent une gestion du risque saine et efficace et n'encouragent pas une prise de risques incompatible avec les profils de risques, règles ou actes constitutifs du Gestionnaire ou de PIMCO Funds: Global Investors Series plc (la « Société »).

La politique de rémunération comprend également des informations sur l'intégration des risques en matière de durabilité dans les procédures de rémunération du Gestionnaire, comme l'exige le Règlement (UE) 2019/2088.

La rémunération se compose de toutes les formes de paiements ou d'avantages accordés directement ou indirectement, mais au nom du Gestionnaire, en contrepartie des services professionnels fournis par le personnel. Cela comprend, le cas échéant : (i) toutes les formes de paiements ou d'avantages versés par le Gestionnaire ; (ii) les montants payés par la Société, y compris toute partie des commissions de performance ; et/ou (iii) tout transfert de parts ou d'actions de toute Société, en échange de services professionnels fournis par le Personnel identifié. La rémunération fixe désigne les paiements ou les avantages sans tenir compte de critères de performance. La rémunération variable correspond aux paiements ou aux avantages supplémentaires accordés en fonction des performances ou, dans certains cas, d'autres critères contractuels.

Des informations sont fournies concernant (a) le personnel du Gestionnaire ; (b) le personnel appartenant à la haute direction ; et (c) le personnel qui a la capacité d'influencer de façon importante le profil de risque du Fonds, y compris les personnes qui, bien que n'étant pas directement employées par le Gestionnaire, sont affectées par leur employeur pour fournir des services directement au Gestionnaire (« Délégués »).

Le montant de la rémunération totale accordée par le Gestionnaire à son personnel, qui a été affecté aux activités liées aux OPCVM du Gestionnaire au titre de l'exercice de ce dernier clôturé le 31 décembre 2022, s'élève à 180 000 EUR. Ce montant comprend une rémunération fixe de 180 000 EUR et une rémunération variable de 0 EUR. La rémunération décrite ci-dessus a été versée à 3 bénéficiaires au total.

Le montant de la rémunération globale, qui a été attribuée aux activités liées aux OPCVM du Gestionnaire pour l'exercice du Gestionnaire clos le 31 décembre 2022, accordée par celui-ci à sa haute direction s'élève à 0 USD. Pour les autres membres de son personnel dont les actions ont une incidence importante sur le profil de risque des activités liées aux OPCVM du Gestionnaire, le montant s'élève à 0 USD.

Le montant de la rémunération totale attribuée par les Délégués à leur Personnel identifié et attribuée aux compartiments au titre de l'exercice clos le 31 décembre 2022 s'élève à 9 907 534 USD. Ce montant comprend une rémunération fixe de 82 946 USD et une rémunération variable de 9 824 588 USD. La rémunération décrite ci-dessus a été versée à 61 bénéficiaires au total.

DESCRIPTION		ACTIONS	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		78 176 958	$ 777 876
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
1MDB Global Investments Ltd. 4,400 % éch. 09/03/2023	$	60 100	59 799
NWD Finance BVI Ltd. 6,150 % éch. 16/03/2025		58 900	58 796
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2032 (b)		47 626	45 922
Periama Holdings LLC 5,950 % éch. 19/04/2026		43 611	41 051
Greenko Wind Projects Mauritius Ltd. 5,500 % éch. 06/04/2025		39 900	39 436
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,900 % éch. 30/11/2026	MYR	135 700	33 181
Singapore Airlines Ltd. 3,375 % éch. 19/01/2029	$	33 300	32 563
Muthoot Finance Ltd. 4,400 % éch. 02/09/2023		31 162	30 736
Sands China Ltd. 5,625 % éch. 08/08/2025		33 300	30 510
Indika Energy Capital Pte. Ltd. 8,250 % éch. 22/10/2025		26 300	26 617
Mong Duong Finance Holdings BV 5,125 % éch. 07/05/2029		30 159	26 187
Standard Chartered PLC 7,750 % éch. 15/08/2027		26 300	25 297
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % éch. 05/03/2027		26 820	25 131
India Toll Roads 5,500 % éch. 19/08/2024		23 043	22 538
West China Cement Ltd. 4,950 % éch. 08/07/2026		28 475	22 064
Bank of East Asia Ltd. 4,875 % éch. 22/04/2032		22 100	21 852
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 3,200 % éch. 24/09/2026		21 200	21 405
Freeport Indonesia PT 5,315 % éch. 14/04/2032		21 800	21 363
Melco Resorts Finance Ltd. 5,750 % éch. 21/07/2028		25 577	20 902

DESCRIPTION		ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		88 240 050	$ 878 027
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,900 % éch. 30/11/2026	MYR	135 700	32 874
ReNew Power Pvt Ltd. 6,450 % éch. 27/09/2022	$	30 754	30 626
Singapore Airlines Ltd. 3,375 % éch. 19/01/2029		33 300	29 719
Vedanta Resources Finance PLC 13,875 % éch. 21/01/2024		29 195	28 584
Banque de développement chinoise 4,040 % éch. 06/07/2028	CNY	167 700	28 001
CNAC HK Finbridge Co. Ltd. 4,625 % éch. 14/03/2023	$	23 360	23 858
JSW Steel Ltd. 5,050 % éch. 05/04/2032		27 400	23 427
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % éch. 05/03/2027		22 600	21 292
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 3,200 % éch. 24/09/2026		21 200	20 470
ABJA Investment Co. Pte. Ltd. 5,450 % éch. 24/01/2028		19 700	20 453
Celestial Miles Ltd. 5,750 % éch. 31/01/2024		19 500	19 663
Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,950 % éch. 24/10/2022		18 600	18 546
Cathay Pacific Finance Ltd. 2,750 % éch. 05/02/2026	HKD	138 000	18 544
JSW Steel Ltd. 5,375 % éch. 04/04/2025	$	17 681	17 805
NWD Finance BVI Ltd. 5,250 % éch. 22/03/2026		18 000	17 649
ICBCIL Finance Co. Ltd. 1,880 % éch. 25/01/2027		17 700	17 336
Central China Real Estate Ltd. 6,875 % éch. 08/08/2022		23 000	16 936
1MDB Global Investments Ltd. 4,400 % éch. 09/03/2023		17 500	16 877
Muthoot Finance Ltd. 6,125 % éch. 31/10/2022		16 086	16 017

(a) Le Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS / VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		11 910 872	$ 118 533
Obligation internationale du gouvernement indonésien 4,650 % éch. 20/09/2032	$	6 900	6 758
Billets du Trésor américain 3,250 % éch. 31/08/2024		6 100	6 080
Korea Electric Power Corp. 5,375 % éch. 06/04/2026		6 000	6 056
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. 4,602 % éch. 15/06/2032		5 800	5 794
Korea National Oil Corp. 2,125 % éch. 18/04/2027		5 300	5 101
China Construction Bank Corp. 2,850 % éch. 21/01/2032		4 400	4 390
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,700 % éch. 06/06/2032		4 000	4 057
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2032 (b)		4 083	3 899
Misc Capital Two Labuan Ltd. 3,625 % éch. 06/04/2025		3 900	3 897
Sunny Express Enterprises Corp. 2,950 % éch. 01/03/2027		3 900	3 891
Reliance Industries Ltd. 2,875 % éch. 12/01/2032		3 700	3 691
Airport Authority Hong Kong 2,500 % éch. 12/01/2032		3 600	3 597
Shinhan Card Co. Ltd. 2,500 % éch. 27/01/2027		3 600	3 530
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara 3,375 % éch. 05/02/2030		3 600	3 528
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,900 % éch. 30/11/2026	MYR	14 300	3 497
Pertamina Persero PT 2,300 % éch. 09/02/2031	$	3 800	3 482
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT 4,625 % éch. 20/07/2023		3 200	3 235
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,400 % éch. 06/06/2027		3 200	3 200
KB Kookmin Card Co. Ltd. 4,000 % éch. 09/06/2025		3 200	3 198

DESCRIPTION		ACTIONS / VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		12 245 104	$ 121 876
AIA Group Ltd. 2,700 % éch. 07/04/2023	$	4 800	4 511
China Construction Bank Corp. 2,850 % éch. 21/01/2032		4 400	4 138
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,700 % éch. 06/06/2032		4 000	3 972
Sunny Express Enterprises Corp. 2,950 % éch. 01/03/2027		3 900	3 869
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,900 % éch. 30/11/2026	MYR	14 300	3 464
Geely Automobile Holdings Ltd. 3,625 % éch. 25/01/2023	$	3 240	3 218
Pertamina Persero PT 2,300 % éch. 09/02/2031		3 800	3 193
KB Kookmin Card Co. Ltd. 4,000 % éch. 09/06/2025		3 200	3 155
Development Bank of the Philippines 2,375 % éch. 11/03/2031		3 410	2 903
Shriram Transport Finance Co. Ltd. 5,950 % éch. 24/10/2022		2 900	2 898
Tencent Holdings Ltd. 3,595 % éch. 19/01/2028		3 100	2 775
Oversea-Chinese Banking Corp. Ltd. 4,602 % éch. 15/06/2032		2 900	2 752
Reliance Industries Ltd. 2,875 % éch. 12/01/2032		3 000	2 615
Mizuho Financial Group, Inc. 2,564 % éch. 13/09/2031		2 900	2 428
NWD Finance BVI Ltd. 6,150 % éch. 16/03/2025		2 400	2 364
Obligation internationale du gouvernement indonésien 1,300 % éch. 23/03/2034	€	2 800	2 293
Dianjian Haiyu Ltd. 4,300 % éch. 20/06/2024	$	2 200	2 244
Prudential PLC 2,950 % éch. 03/11/2033		2 300	2 107
Bangkok Bank PCL 3,466 % éch. 23/09/2036		2 300	2 010

(a) Le Fonds Asia Strategic Interest Bond Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022			
Credit Suisse Group AG 9,750 % éch. 23/06/2027	$	77 000	$ 77 000
Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 %	€	50 300	74 676
BNP Paribas S.A. 4,625 % éch. 12/01/2027	$	78 900	72 189
Société Générale S.A. 6,221 % éch. 15/06/2033		70 100	69 660
		ACTIONS	
Wells Fargo & Co.		1 197 200	63 954
Bank of America Corp.		1 429 200	63 135
JPMorgan Chase & Co.		438 400	62 632
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
BNP Paribas S.A. 7,750 % éch. 16/08/2029	$	56 800	56 800
BNP Paribas S.A. 6,875 % éch. 06/12/2029	€	55 800	55 736
		ACTIONS	
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		5 288 582	52 639
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Cooperatieve Rabobank UA 4,875 % éch. 29/06/2029	€	51 000	50 499
Bank of America Corp. 1,843 % éch. 04/02/2025	$	44 500	44 500
Barclays PLC 8,875 % éch. 15/09/2027	£	36 200	44 430
BNP Paribas S.A. 9,250 % éch. 17/11/2027	$	43 500	43 500
UBS Group AG 4,875 % éch. 12/02/2027		42 000	41 420
Barclays PLC 8,000 % éch. 15/03/2029		40 000	40 000
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen 5,875 % éch. 23/05/2042		39 400	39 400
Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % éch. 21/11/2033		36 700	36 700
Deutsche Bank AG 3,742 % éch. 07/01/2033		49 100	35 608
Erste Group Bank AG 4,250 % éch. 15/10/2027	€	34 200	32 028
Intesa Sanpaolo SpA 6,375 % éch. 30/03/2028		29 000	31 904
AIB Group PLC 6,250 % éch. 23/06/2025		27 400	29 600
NN Group NV 5,250 % éch. 01/03/2043		29 100	28 761
Deutsche Bank AG 6,750 % éch. 30/10/2028		26 200	28 744
Deutsche Bank AG 10,000 % éch. 01/12/2027		28 400	28 431
ING Groep NV 4,125 % éch. 24/08/2033		27 500	27 832
Deutsche Bank AG 4,000 % éch. 24/06/2032		25 000	27 643
Bank of Ireland Group PLC 7,500 % éch. 19/05/2025		25 400	26 679
Lloyds Banking Group PLC 4,947 % éch. 27/06/2025		24 800	25 301
Permanent TSB Group Holdings PLC 13,250 % éch. 26/10/2027		24 600	24 085
Lloyds Banking Group PLC 8,500 % éch. 27/09/2027	£	19 500	22 690
Nordea Bank Abp 3,750 % éch. 01/03/2029	$	26 200	22 672
Électricité de France S.A. 2,875 % éch. 15/12/2026	€	21 600	22 668
Société Générale S.A. 3,337 % éch. 21/01/2033	$	30 100	22 012
Deutsche Bank AG 3,729 % éch. 14/01/2032		30 350	21 589

DESCRIPTION		ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		4 576 800	$ 459 765
Bank of America Corp.		3 585 748	156 263
JPMorgan Chase & Co.		720 500	97 236
Wells Fargo & Co.		1 929 696	95 435
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
UBS AG 1,750 % éch. 21/04/2022	$	85 273	85 421
Deutsche Bank AG 5,625 % éch. 19/05/2031	€	76 100	81 330
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,000 % éch. 29/03/2024		72 400	75 102
		ACTIONS	
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		7 092 484	70 601
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
UniCredit SpA 6,625 % éch. 03/06/2023	€	65 600	66 841
Telefonica Europe BV 4,375 % éch. 14/12/2024		58 700	59 848
		ACTIONS	
Goldman Sachs Group, Inc.		146 782	53 847
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 5,875 % éch. 24/09/2023	€	44 000	52 732
Vodafone Group PLC 7,000 % éch. 04/04/2079	$	51 600	51 094
		ACTIONS	
Lloyds Banking Group PLC		70 635 700	50 317
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Stichting AK Rabobank Certificaten 6,500 %	€	46 252	46 684
UBS AG 7,625 % éch. 17/08/2022	$	41 200	41 752
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,000 % éch. 15/01/2026	€	42 600	40 932
Lloyds Banking Group PLC 7,625 % éch. 27/06/2023	£	28 400	38 940
Permanent TSB Group Holdings PLC 2,125 % éch. 26/09/2024	€	34 000	33 828
UniCredit SpA 9,250 % éch. 03/06/2022		30 000	32 890

(a) Le Fonds PIMCO Capital Securities Fund est investi en actions d'un Fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022				
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,375 % éch. 07/06/2032	€	15 600	$	15 026
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,000 % éch. 15/11/2029		10 400		10 330
Banque européenne d'investissement 1,500 % éch. 15/06/2032		5 600		5 927
Obligation internationale du gouvernement canadien 2,250 % éch. 01/12/2029	CAD	6 400		4 621
Billets du Trésor américain 1,125 % éch. 15/01/2025	$	3 600		3 583
Vonovia SE 2,375 % éch. 25/03/2032	€	2 700		2 954
NTT Finance Corp. 4,239 % éch. 25/07/2025	$	2 900		2 900
Bon du Trésor britannique 0,875 % éch. 31/07/2033	£	3 000		2 417
Volkswagen International Finance NV 4,250 % éch. 15/02/2028	€	2 400		2 395
UniCredit SpA 5,850 % éch. 15/11/2027		2 200		2 213
Compass Group PLC 4,375 % éch. 08/09/2032	£	1 900		2 192
Deutsche Bank AG 1,875 % éch. 23/02/2028	€	1 900		2 149
GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 4,950 % éch. 20/07/2049	$	2 000		1 999
CaixaBank S.A. 3,750 % éch. 07/09/2029	€	1 900		1 898
Telus Corp. 3,400 % éch. 13/05/2032	$	1 900		1 895
ABN AMRO Bank NV 2,470 % éch. 13/12/2029		2 000		1 812
Union Pacific Corp. 4,950 % éch. 09/09/2052		1 820		1 808
NatWest Group PLC 4,067 % éch. 06/09/2028	€	1 600		1 598
NE Property BV 2,000 % éch. 20/01/2030		1 400		1 584
République d'Allemagne 0,000 % éch. 15/08/2031		1 400		1 464
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,472 % éch. 14/01/2029	$	1 300		1 300
Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % éch. 05/09/2027	€	1 300		1 299
Amgen, Inc. 3,000 % éch. 22/02/2029	$	1 300		1 296

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022				
Volkswagen International Finance NV 4,250 % éch. 15/02/2028	€	2 400	$	2 403
Realty Income Corp. 1,125 % éch. 13/07/2027	£	1 800		2 266
CTP NV 0,625 % éch. 27/09/2026	€	2 100		2 228
Kojamo Oyj 0,875 % éch. 28/05/2029		2 900		2 177
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 2,200 % éch. 02/12/2026	AUD	3 350		1 936
Union Pacific Corp. 4,950 % éch. 09/09/2052	$	1 820		1 885
Vmed O2 UK Financing PLC 4,750 % éch. 15/07/2031		2 400		1 848
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,750 % éch. 30/09/2030		2 100		1 743
T-Mobile USA, Inc. 2,625 % éch. 15/04/2026		1 900		1 734
Telus Corp. 3,400 % éch. 13/05/2032		1 900		1 729
Woolworths Group Ltd. 0,375 % éch. 15/11/2028	€	2 100		1 683
UBS AG 5,125 % éch. 15/05/2024	$	1 700		1 675
NatWest Group PLC 4,067 % éch. 06/09/2028	€	1 600		1 673
Holding d'Infrastructures des Métiers de l'Environnement 0,125 % éch. 16/09/2025		1 400		1 530
Sunnova Energy Corp. 5,875 % éch. 01/09/2026	$	1 600		1 487
AES Corp. 2,450 % éch. 15/01/2031		1 859		1 484
BNP Paribas S.A. 0,500 % éch. 04/06/2026	€	1 500		1 462
Kilroy Realty LP 2,500 % éch. 15/11/2032	$	2 000		1 458
Boston Properties LP 3,400 % éch. 21/06/2029		1 400		1 451
HAT Holdings LLC 3,375 % éch. 15/06/2026		1 500		1 365
Banco de Sabadell S.A. 0,875 % éch. 16/06/2028	€	1 500		1 296
Intesa Sanpaolo SpA 0,750 % éch. 16/03/2028		1 400		1 261
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 4,875 % éch. 15/01/2030	$	1 200		1 180
Enel Finance International NV 2,650 % éch. 10/09/2024		1 200		1 170
Banque européenne pour la reconstruction et le développement 1,500 % éch. 13/02/2025		1 240		1 170
Santander Holdings USA, Inc. 5,807 % éch. 09/09/2026		1 160		1 157
Iberdrola Finanzas S.A. 1,000 % éch. 07/03/2024	€	1 100		1 146
Contemporary Ruiding Development Ltd. 1,500 % éch. 09/09/2026	$	1 300		1 129
KBC Group NV 0,250 % éch. 01/03/2027	€	1 300		1 092
Rayonier LP 2,750 % éch. 17/05/2031	$	1 300		1 090
Wesfarmers Ltd. 0,954 % éch. 21/10/2033	€	1 200		1 079
Tesco Corporate Treasury Services PLC 0,375 % éch. 27/07/2029		1 300		1 067
Johnson Controls International PLC 2,000 % éch. 16/09/2031	$	1 400		1 052
Dell International LLC 6,200 % éch. 15/07/2030		1 000		1 041

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022				
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2026 (a)	$	122 432	$	130 556
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (a)		61 007		63 239
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/01/2028 (a)		46 911		47 954
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2027 (a)		47 872		47 317
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2032 (a)		42 711		44 608
Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 22/11/2027	£	29 721		40 430
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (a)	$	31 808		33 578
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2025 (a)		29 633		31 799
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (a)		27 416		29 144
Obligation internationale du gouvernement espagnol 0,650 % éch. 30/11/2027	€	24 564		28 729
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/10/2027 (a)	$	26 747		26 983
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % éch. 15/05/2033	€	22 885		26 551
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/04/2023 (a)	$	25 206		26 094
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % éch. 26/05/2025	€	21 190		24 723
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2031		18 355		24 376
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 01/03/2025		18 245		22 059
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2027 (a)	$	19 033		20 029
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2025 (a)		18 135		19 615
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2023 (a)		18 081		18 608
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	119 700		16 300
Obligation internationale du gouvernement espagnol 0,150 % éch. 30/11/2023	€	12 305		14 693
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,350 % éch. 15/09/2024		11 607		14 680
République d'Allemagne 0,100 % éch. 15/04/2023		12 523		14 671
Obligation internationale du gouvernement français 1,500 % éch. 25/05/2031		11 800		11 658
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2026 (a)	$	11 042		11 569
OCP Euro CLO DAC 2,198 % éch. 15/01/2032	€	10 100		10 993

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022				
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2026 (a)	$	72 896	$	71 204
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2022 (a)		61 136		61 472
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2023 (a)		59 450		59 603
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2031 (a)		55 318		53 581
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % éch. 15/05/2030	€	45 115		52 461
Obligation internationale du gouvernement français 0,250 % éch. 25/07/2024		45 613		48 873
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2027 (a)	$	49 131		45 893
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2032 (a)		44 334		42 524
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/04/2023 (a)		41 746		41 146
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2027 (a)		22 868		22 027
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % éch. 15/05/2033	€	23 940		21 435
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (a)	$	17 343		16 709
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,750 % éch. 15/07/2028 (a)		16 355		16 537
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2025 (a)		14 730		14 096
Obligation internationale du gouvernement français 1,500 % éch. 25/05/2031	€	11 800		11 720
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2025 (a)	$	11 484		10 955
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2031	€	10 039		10 822
OCP Euro CLO DAC 2,198 % éch. 15/01/2032		10 100		9 932
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 01/03/2029		8 694		9 453
Carlyle Euro CLO DAC 2,428 % éch. 15/08/2030		7 382		7 183

(a) Le montant du principal du titre est ajusté sur l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022				
Billets du Trésor américain 3,125 % éch. 31/08/2027	$	3 825	$	3 688
Billets du Trésor américain 2,750 % éch. 15/08/2032		3 800		3 429
Wells Fargo & Co. 4,897 % éch. 25/07/2033		2 300		2 300
Billets du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2032		2 100		2 098
Billets du Trésor américain 2,750 % éch. 30/04/2027		2 100		2 087
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	26 800		1 962
Billets du Trésor américain 2,500 % éch. 30/04/2024	$	1 900		1 895
		ACTIONS		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		178 332		1 775
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Morgan Stanley 4,889 % éch. 20/07/2033	$	1 700		1 745
JPMorgan Chase & Co. 4,912 % éch. 25/07/2033		1 700		1 707
Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/11/2051		1 759		1 649
Bank of America Corp. 5,015 % éch. 22/07/2033		1 600		1 616
Netflix, Inc. 5,375 % éch. 15/11/2029		1 500		1 530
Citigroup, Inc. 3,785 % éch. 17/03/2033		1 600		1 503
Venture Global Calcasieu Pass LLC 3,875 % éch. 15/08/2029		1 425		1 266
MSCI, Inc. 3,625 % éch. 01/11/2031		1 400		1 232
Obligations du Trésor américain 2,000 % éch. 15/11/2041		1 200		1 179
Billets du Trésor américain 1,875 % éch. 15/02/2032		1 187		1 112
Crown Castle International Corp. 2,250 % éch. 15/01/2031		1 400		1 079
Weyerhaeuser Co. 4,000 % éch. 09/03/2052		1 125		998
American Tower Corp. 2,950 % éch. 15/01/2051		1 425		948
Goldman Sachs Group, Inc. 4,482 % éch. 23/08/2028		900		900
Citigroup, Inc. 6,270 % éch. 17/11/2033		900		900

DESCRIPTION	ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	573 132	$	5 703
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Billets du Trésor américain 2,750 % éch. 15/08/2032	$ 3 000		2 748
Billets du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2032	2 100		2 084
Billets du Trésor américain 2,750 % éch. 30/04/2027	2 100		2 068
Billets du Trésor américain 2,500 % éch. 30/04/2024	1 900		1 877
Caesars Entertainment, Inc. 6,250 % éch. 01/07/2025	1 500		1 550
Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/11/2051	1 759		1 536
Carnival Corp. 4,000 % éch. 01/08/2028	1 600		1 488
Cornerstone Building Brands, Inc. 7,568 % éch. 12/04/2028	1 440		1 333
Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/02/2041	1 347		1 293
Obligations du Trésor américain 2,000 % éch. 15/11/2041	1 400		1 201
Spirit AeroSystems, Inc. 7,500 % éch. 15/04/2025	1 100		1 099
Wells Fargo & Co. 4,897 % éch. 25/07/2033	1 200		1 092
Billets du Trésor américain 1,875 % éch. 15/02/2032	1 187		1 078
Live Nation Entertainment, Inc. 6,500 % éch. 15/05/2027	1 000		1 054
Viking Cruises Ltd. 13,000 % éch. 15/05/2025	900		978
Triumph Group, Inc. 8,875 % éch. 01/06/2024	885		887
Endeavor Energy Resources LP 5,750 % éch. 30/01/2028	700		724
PUG LLC 7,884 % éch. 12/02/2027	771		721
Intercontinental Exchange, Inc. 3,000 % éch. 15/09/2060	975		711

(a) Le Fonds PIMCO Credit Opportunities Bond Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

DESCRIPTION		ACTIONS	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		58 696 293	$ 584 096
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Federal Home Loan Bank 4,345 % éch. 06/03/2023	$	100 000	100 000
Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042		98 500	99 646
Nexi SpA 2,125 % éch. 30/04/2029	€	43 300	47 439
Organon & Co. 2,875 % éch. 30/04/2028		39 000	42 644
Volvo Car AB 4,250 % éch. 31/05/2028		31 900	33 996
Atlantia SpA 1,875 % éch. 12/02/2028		28 800	31 235
Banco de Sabadell S.A. 5,375 % éch. 08/09/2026		23 700	23 781
Corsair International Ltd. 5,473 % éch. 28/01/2027		18 800	20 989
Vmed O2 UK Financing PLC 4,000 % éch. 31/01/2029	£	15 600	19 959
Prosus NV 3,680 % éch. 21/01/2030	$	20 200	19 911
Market Bidco Finco PLC 4,750 % éch. 04/11/2027	€	21 200	19 425
Albion Financing SARL 5,250 % éch. 15/10/2026		16 700	18 641
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,138 % éch. 14/09/2028	$	16 800	16 800
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS) 5,500 % éch. 01/12/2052		16 400	16 306
Obligation internationale du gouvernement russe 5,250 % éch. 23/06/2047		28 000	15 715
Deutsche Bank AG 2,552 % éch. 07/01/2028		15 600	15 600
TDC Net A/S 5,056 % éch. 31/05/2028	€	12 800	13 730
Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % éch. 25/01/2030	$	13 710	13 367
CPI Property Group S.A. 1,750 % éch. 14/01/2030	€	10 800	11 936

DESCRIPTION		ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		57 583 875	$ 573 000
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		5 083 800	506 390
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds US Short-Term Fund (a)		20 706 660	209 000
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 4,500 % éch. 26/10/2046	$	125 200	118 350
Obligation internationale du gouvernement qatari 4,400 % éch. 16/04/2050		58 900	56 894
Occidental Petroleum Corp. 5,500 % éch. 01/12/2025		52 000	53 474
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 5,750 % éch. 30/09/2049		55 900	48 665
AT&T, Inc. 3,650 % éch. 15/09/2059		53 173	45 787
Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat d'Abou Dabi 2,700 % éch. 02/09/2070		55 300	45 379
UniCredit SpA 2,200 % éch. 22/07/2027	€	42 250	43 392
UPC Broadband Finco BV 4,875 % éch. 15/07/2031	$	51 900	43 372
Intesa Sanpaolo SpA 5,500 % éch. 01/03/2028	€	45 129	40 066
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 3,000 % éch. 29/06/2027	$	77 600	38 883
Abertis Infraestructuras S.A. 3,375 % éch. 27/11/2026	£	27 500	38 225
Obligation internationale du gouvernement indonésien 0,900 % éch. 14/02/2027	€	37 483	38 074
Towd Point Mortgage Funding PLC 3,826 % éch. 20/07/2045	£	28 193	37 867
Obligation internationale du gouvernement indonésien 4,625 % éch. 15/04/2043	$	35 100	37 450
Iliad Holding SASU 6,500 % éch. 15/10/2026		37 150	36 370
Albion Financing SARL 6,752 % éch. 17/08/2026	€	32 354	34 855
CGG S.A. 8,750 % éch. 01/04/2027	$	39 100	34 740

(a) Le Fonds Diversified Income Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund 31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS / VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		3 415 911	$ 33 995
Organon & Co. 2,875 % éch. 30/04/2028	€	4 200	4 584
SIG Combibloc Purchase Co. SARL 1,875 % éch. 18/06/2023		3 900	4 102
Nexi SpA 2,125 % éch. 30/04/2029		3 600	3 944
Petroleos Mexicanos 4,875 % éch. 21/02/2028		2 500	2 839
Volvo Car AB 4,250 % éch. 31/05/2028		2 600	2 771
Deutsche Bank AG 1,750 % éch. 19/11/2030		3 600	2 691
Syngenta Finance NV 3,375 % éch. 16/04/2026		2 600	2 328
Banco de Sabadell S.A. 5,375 % éch. 08/09/2026		2 300	2 308
CPI Property Group S.A. 1,750 % éch. 14/01/2030		2 200	2 251
HSBC Holdings PLC 5,210 % éch. 11/08/2028	$	2 200	2 200
AA Bond Co. Ltd. 5,500 % éch. 31/07/2050	£	2 200	2 188
Atlantia SpA 1,875 % éch. 12/02/2028	€	1 900	2 058
Altice Financing S.A. 3,000 % éch. 15/01/2028		2 000	1 952
Corsair International Ltd. 5,473 % éch. 28/01/2027		1 600	1 786
Albion Financing SARL 5,250 % éch. 15/10/2026		1 600	1 786
Prosus NV 3,680 % éch. 21/01/2030	$	1 700	1 676
Market Bidco Finco PLC 4,750 % éch. 04/11/2027	€	1 700	1 558
Virgin Money UK PLC 4,000 % éch. 03/09/2027	£	1 400	1 414
Nova Kreditna Banka Maribor d.d. 1,875 % éch. 27/01/2025	€	1 200	1 361
Obligation internationale du gouvernement indonésien 1,100 % éch. 12/03/2033		2 000	1 308
TDC Net A/S 5,056 % éch. 31/05/2028		1 100	1 180

DESCRIPTION		ACTIONS / VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022			
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		580 700	$ 57 791
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		2 844 863	28 309
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds US Short-Term Fund (a)		1 585 189	16 000
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 4,500 % éch. 26/10/2046	$	11 900	12 530
INEOS Finance PLC 3,898 % éch. 01/04/2024	€	9 718	9 626
Madison Park Euro Funding DAC 2,128 % éch. 15/01/2032		7 000	6 606
Harvest CLO DAC 2,775 % éch. 26/06/2030		6 823	6 521
EQT Corp. 6,125 % éch. 01/02/2025	$	6 200	6 373
Asset-Backed Funding Certificates Trust 4,609 % éch. 25/10/2036		7 629	6 208
Soundview Home Loan Trust 4,854 % éch. 25/06/2036		7 208	6 084
Countrywide Asset-Backed Certificates Trust 5,379 % éch. 25/02/2036		6 000	5 253
Obligation internationale du gouvernement qatari 4,400 % éch. 16/04/2050		5 500	5 225
Deutsche Bank AG 1,625 % éch. 20/01/2027	€	4 500	5 161
HSBC Holdings PLC 4,300 % éch. 08/03/2026	$	3 900	4 188
Park Aerospace Holdings Ltd. 4,500 % éch. 15/03/2023		4 000	3 978
Gazprom PJSC Via Gaz Finance PLC 3,000 % éch. 29/06/2027		7 800	3 925
AerCap Ireland Capital DAC 3,150 % éch. 15/02/2024		3 800	3 873
Pertamina Persero PT 6,500 % éch. 07/11/2048		3 700	3 780
Petroleos Mexicanos 4,875 % éch. 21/02/2028	€	4 000	3 771
Intesa Sanpaolo SpA 5,500 % éch. 01/03/2028		4 600	3 748

(a) Le Fonds Diversified Income Duration Hedged Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

DESCRIPTION		ACTIONS	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		20 095	$ 200
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Ford Motor Credit Co. LLC 4,063 % éch. 01/11/2024	$	200	196
Azure Power Solar Energy Pvt Ltd. 5,650 % éch. 24/12/2024		200	194
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % éch. 05/03/2027		200	191
Shriram Transport Finance Co. Ltd. 4,400 % éch. 13/03/2024		200	189
HSBC Holdings PLC 3,973 % éch. 22/05/2030		200	187
Banco BTG Pactual S.A. 2,750 % éch. 11/01/2026		200	178
BNP Paribas S.A. 1,675 % éch. 30/06/2027		200	178
Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042		175	176
Obligation internationale du gouvernement omanais 6,750 % éch. 17/01/2048		200	172
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,472 % éch. 14/01/2029		200	171
Natura Cosmeticos S.A. 4,125 % éch. 03/05/2028		200	164
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 6,500 % éch. 15/02/2048		200	156
Obligation internationale du gouvernement chilien 3,100 % éch. 07/05/2041		200	155
Obligation internationale du gouvernement colombien 5,000 % éch. 15/06/2045		200	140
GE Capital UK Funding Unlimited Co. 5,875 % éch. 18/01/2033	£	100	137
Obligation internationale du gouvernement marocain 4,000 % éch. 15/12/2050	$	200	130
Abertis Infraestructuras S.A. 3,375 % éch. 27/11/2026	£	100	115
Ally Financial, Inc. 8,000 % éch. 01/11/2031	$	100	113
Obligation internationale du gouvernement panaméen 6,700 % éch. 26/01/2036		100	109
Marks & Spencer PLC 4,500 % éch. 10/07/2027	£	100	106
Dell International LLC 6,020 % éch. 15/06/2026	$	100	106
Virgin Media Secured Finance PLC 4,125 % éch. 15/08/2030	£	100	104
NXP BV 5,350 % éch. 01/03/2026	$	100	103
TDC Net A/S 5,056 % éch. 31/05/2028	€	100	102
VMware, Inc. 4,500 % éch. 15/05/2025	$	100	101
Nokia Oyj 3,125 % éch. 15/05/2028	€	100	100
Wells Fargo & Co. 4,540 % éch. 15/08/2026	$	100	100
CaixaBank S.A. 3,750 % éch. 07/09/2029	€	100	100
Lincoln Financing SARL 3,625 % éch. 01/04/2024		100	100
Kilroy Realty LP 4,750 % éch. 15/12/2028	$	100	99
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % éch. 16/02/2026	£	100	99
Aviation Capital Group LLC 5,500 % éch. 15/12/2024	$	100	99
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4,000 % éch. 09/11/2026	€	100	98
Flex Ltd. 4,875 % éch. 15/06/2029	$	100	97
Crown European Holdings S.A. 2,875 % éch. 01/02/2026	€	100	97
Edgewell Personal Care Co. 5,500 % éch. 01/06/2028	$	100	97

DESCRIPTION		ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		20 095	$ 200
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Azure Power Solar Energy Pvt Ltd. 5,650 % éch. 24/12/2024	$	200	196
Ford Motor Credit Co. LLC 4,063 % éch. 01/11/2024		200	196
Shriram Transport Finance Co. Ltd. 4,400 % éch. 13/03/2024		200	190
Skandinaviska Enskilda Banken AB 4,000 % éch. 09/11/2026	€	100	108
Sunnova Energy Corp. 5,875 % éch. 01/09/2026	$	100	94
Kilroy Realty LP 4,750 % éch. 15/12/2028		100	92
VICI Properties LP 3,750 % éch. 15/02/2027		100	90
INEOS Finance PLC 2,875 % éch. 01/05/2026	€	100	88
Ontex Group NV 3,500 % éch. 15/07/2026		100	84

(a) Le Fonds Diversified Income ESG Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes sur la composition du portefeuille Fonds Dynamic Bond Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		30 009 500	$	298 612
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Deutsche Bank AG 6,119 % éch. 14/07/2026	$	12 202		12 202
Eurosail PLC 4,461 % éch. 13/06/2045	£	11 226		11 766
Stratton Mortgage Funding PLC 4,426 % éch. 20/07/2060		10 705		11 546
OCP Euro CLO DAC 0,000 % éch. 20/01/2033	€	10 000		10 323
Palmer Square European Loan Funding DAC 3,993 % éch. 12/04/2032		9 700		9 639
Madison Park Euro Funding DAC 2,128 % éch. 15/01/2032		9 800		9 453
Harmony French Home Loans 2,558 % éch. 27/05/2062		7 500		8 412
Eurosail PLC 3,761 % éch. 13/03/2045	£	7 250		7 149
Clarinda Park CLO DAC 2,698 % éch. 15/02/2034	€	7 550		7 027
Resloc UK PLC 3,742 % éch. 15/12/2043	£	6 492		6 719
Eurosail PLC 3,984 % éch. 10/06/2044		6 316		6 659
JPMorgan Chase & Co. 2,595 % éch. 24/02/2026	$	6 400		6 400
Babson CLO Ltd. 5,233 % éch. 20/01/2031		5 700		5 659
Aurium CLO DAC 3,152 % éch. 23/03/2032	€	5 000		5 487
Stratton BTL Mortgage Funding 3,656 % éch. 20/01/2054	£	3 800		5 151
Dryden Euro CLO DAC 2,358 % éch. 17/01/2033	€	5 000		4 923
Barings CLO Ltd. 5,029 % éch. 15/04/2031	$	5 000		4 835
Credit Suisse Group AG 6,442 % éch. 11/08/2028		4 750		4 750
Banco Santander S.A. 5,147 % éch. 18/08/2025		4 400		4 400

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		26 435 944	$	263 070
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Billets du Trésor américain 1,875 % éch. 31/07/2022	$	46 570		46 592
Billets du Trésor américain 1,375 % éch. 31/10/2028		41 550		40 065
Billets du Trésor américain 0,875 % éch. 15/11/2030		35 600		33 048
Billets du Trésor américain 0,500 % éch. 28/02/2026		30 100		28 181
Lloyds Banking Group PLC 7,625 % éch. 27/06/2023	£	20 128		27 598
Billets du Trésor américain 2,000 % éch. 31/07/2022	$	19 900		19 915
NatWest Group PLC 0,750 % éch. 15/11/2025	€	13 300		12 635
Obligation internationale du gouvernement péruvien 6,150 % éch. 12/08/2032	PEN	53 300		12 243
Billets du Trésor américain 2,375 % éch. 15/05/2029	$	7 700		8 046
Billets du Trésor américain 1,750 % éch. 15/07/2022		7 740		7 743
Billets du Trésor américain 0,250 % éch. 30/09/2025		7 600		7 105
Obligation internationale du gouvernement péruvien 6,350 % éch. 12/08/2028	PEN	27 500		6 898
Transocean, Inc. 7,250 % éch. 01/11/2025	$	8 000		6 700
Deutsche Bank AG 1,375 % éch. 03/09/2026	€	6 400		6 118
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 4,000 % éch. 01/05/2031	$	7 200		5 976
Coty, Inc. 5,000 % éch. 15/04/2026		6 300		5 802
Darrowby PLC 1,000 % éch. 20/12/2057	£	4 195		5 506
Obligation internationale du gouvernement qatari 4,500 % éch. 23/04/2028	$	5 100		5 247
Obligation internationale du gouvernement qatari 3,875 % éch. 23/04/2023		4 900		4 909

(a) Le Fonds Dynamic Bond Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille Fonds Dynamic Multi-Asset Fund 31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022				
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 30/05/2022	¥	13 700 000	€	104 930
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 27/06/2022		13 690 000		104 065
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 24/10/2022		13 250 000		95 237
République d'Allemagne 1,750 % éch. 04/07/2022	€	71 900		72 302
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 01/08/2022	¥	9 030 000		65 254
		ACTIONS		
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Income Fund (a)		4 085 684		65 150
Generac Holdings, Inc.		162 200		35 909
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligation internationale du gouvernement français 2,250 % éch. 25/10/2022	€	34 500		34 654
		ACTIONS		
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund (a)		2 716 001		31 316
Micron Technology, Inc.		481 100		31 136
Merck & Co., Inc.		364 700		29 252
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Bons du Trésor français 0,000 % éch. 16/03/2022	€	29 000		29 005
Union européenne 0,000 % éch. 05/05/2022		27 800		27 844
		ACTIONS		
Exxon Mobil Corp.		263 000		27 804
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Bons du Trésor de l'Union européenne 0,000 % échéance 05/08/2022	€	27 000		27 036
Bons du Trésor italien 0,000 % échéance 31/03/2023		27 000		26 856
		ACTIONS		
GXO Logistics, Inc.		416 900		26 589
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Bons du Trésor espagnol 0,000 % échéance 13/01/2023	€	26 300		26 255
		ACTIONS		
Hanwha Solutions Corp.		680 800		25 043
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
République d'Allemagne 0,010 % échéance 08/04/2022	€	23 900		23 907
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % échéance 01/03/2023	¥	3 091 000		21 433
OCP Euro CLO DAC 0,000 % échéance 20/01/2033	€	20 900		20 796
		ACTIONS		
Incyte Corp.		262 900		19 290
Vestas Wind Systems A/S		684 000		18 277
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Goldman Sachs Group, Inc. 2,732 % échéance 07/02/2025	€	17 700		17 861
		ACTIONS		
Cigna Corp.		76 900		17 747
SK Innovation Co. Ltd.		128 100		17 046

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022				
Evergreen Marine Corp Taiwan Ltd.		14 474 222	€	66 490
JinkoSolar Holding Co. Ltd.		1 087 412		65 720
Stora Enso Oyj « R »		3 280 700		52 565
Arista Networks, Inc.		401 300		50 546
Alphabet, Inc.		107 750		42 987
UPM-Kymmene Oyj		1 315 900		41 800
First Solar, Inc.		288 200		41 619
Apple, Inc.		254 600		40 709
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Bons du Trésor français 0,000 % échéance 04/05/2022	€	38 200		38 227
		ACTIONS		
Mondi PLC		2 138 349		36 549
COSCO Shipping Holdings Co. Ltd. « H »		16 606 137		28 378
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.		47 600		28 362
Merck & Co., Inc.		287 200		27 597
AbbVie, Inc.		192 600		27 381
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Bons du Trésor espagnol 0,000 % échéance 13/01/2023	€	26 300		26 276
		ACTIONS		
Baidu, Inc.		193 550		25 544
Tokyo Electron Ltd.		57 800		25 286
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Capital Securities Fund (a)		2 401 802		25 060
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
République d'Allemagne 1,750 % échéance 04/07/2022	€	24 900		24 952
		ACTIONS		
Fortum Oyj		1 135 200		24 717
Vertex Pharmaceuticals, Inc.		80 600		24 393
Coinbase Global, Inc.		144 300		22 903
AP Moller - Maersk A/S « B »		7 781		22 659
Genscript Biotech Corp.		6 344 400		21 951
Humana, Inc.		43 100		21 791
Cigna Corp.		76 900		21 417
Mastercard, Inc.		64 600		20 834
Rohm Co. Ltd.		289 100		20 628
Lotes Co. Ltd.		861 336		20 603
Holmen AB « B »		418 600		20 230
Automatic Data Processing, Inc.		97 500		19 798
Skyworks Solutions, Inc.		189 000		18 629
West Fraser Timber Co. Ltd.		227 300		18 595

(a) Le Fonds Dynamic Multi-Asset Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Emerging Local Bond Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS / VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		181 524 166	$ 1 806 501
Obligation internationale du gouvernement indonésien 6,375 % éch. 15/04/2032	IDR	1 918 414 000	125 021
Colombian TES 6,250 % éch. 26/11/2025	COP	523 528 500	105 641
Émission d'investissement du gouvernement malaisien 3,990 % éch. 15/10/2025	MYR	267 690	60 918
Obligation internationale du gouvernement indonésien 8,375 % éch. 15/03/2034	IDR	809 508 000	58 315
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,000 % éch. 17/12/2031	THB	1 852 310	51 311
Colombian TES 5,750 % éch. 03/11/2027	COP	275 048 100	49 751
Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,500 % éch. 04/03/2027	MXN	1 083 900	47 310
Obligation internationale du gouvernement indonésien 6,375 % éch. 15/08/2028	IDR	749 139 000	47 062
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 5,000 % éch. 01/10/2028	CLP	40 410 000	45 824
Obligation internationale du gouvernement singapourien 1,625 % éch. 01/07/2031	SGD	61 700	44 253
Obligation internationale du gouvernement indonésien 9,000 % éch. 15/03/2029	IDR	516 966 000	40 816
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,390 % éch. 17/06/2037	THB	1 471 700	40 774
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,650 % éch. 17/06/2028		1 493 583	39 232
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,582 % éch. 15/07/2032	MYR	153 064	34 224
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 1,585 % éch. 17/12/2035	THB	1 352 900	33 286
Obligation internationale du gouvernement singapourien 2,875 % éch. 01/09/2030	SGD	40 900	32 942
Colombian TES 7,500 % éch. 26/08/2026	COP	144 215 700	32 695
Obligation internationale du gouvernement indonésien 7,000 % éch. 15/02/2033	IDR	502 143 000	32 672
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,899 % éch. 16/11/2027	MYR	143 240	32 105

DESCRIPTION		ACTIONS / VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		187 081 375	$ 1 861 830
Obligation internationale du gouvernement indonésien 6,375 % éch. 15/04/2032	IDR	1 918 414 000	123 739
Colombian TES 6,250 % éch. 26/11/2025	COP	601 928 500	109 633
China Development Bank 3,000 % éch. 07/08/2023	CNY	510 900	81 460
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 1,585 % éch. 17/12/2035	THB	2 954 000	69 306
Colombian TES 5,750 % éch. 03/11/2027	COP	370 098 100	62 996
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 5,000 % éch. 01/10/2028	CLP	54 900 000	61 660
Émission d'investissement du gouvernement malaisien 4,369 % éch. 31/10/2028	MYR	255 460	58 895
QNB Finance Ltd. 6,800 % éch. 04/03/2030	IDR	951 700 000	58 619
Obligation internationale du gouvernement indonésien 8,375 % éch. 15/03/2034		733 486 000	53 869
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,000 % éch. 17/12/2031	THB	1 855 810	51 395
Obligation internationale du gouvernement indonésien 6,375 % éch. 15/08/2028	IDR	714 852 000	45 878
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,650 % éch. 17/06/2028	THB	1 493 583	43 141
China Development Bank 3,420 % éch. 02/07/2024	CNY	260 700	42 006
Obligation internationale du gouvernement singapourien 1,625 % éch. 01/07/2031	SGD	61 700	41 482
Obligation internationale du gouvernement indonésien 9,000 % éch. 15/03/2029	IDR	516 966 000	40 590
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 2,500 % éch. 01/03/2025	CLP	31 660 000	35 236
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,775 % éch. 25/06/2032	THB	1 099 807	34 995
Obligation internationale du gouvernement singapourien 3,375 % éch. 01/09/2033	SGD	40 850	34 728
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,733 % éch. 15/06/2028	MYR	143 800	33 551

(a) Le Fonds Emerging Local Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Emerging Local Bond ESG Fund

décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022			
Colombian TES 7,000 % éch. 26/03/2031	COP	1 603 200	$ 244
Obligation internationale du gouvernement mexicain 7,500 % éch. 03/06/2027	MXN	4 700	216
Obligation internationale du gouvernement malaisien 4,837 % éch. 15/07/2025	MYR	900	209
Émission d'investissement du gouvernement malaisien 4,369 % éch. 31/10/2028		900	206
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 1,585 % éch. 17/12/2035	THB	8 230	186
Banque interaméricaine de développement 5,500 % éch. 07/02/2023	IDR	2 720 000	181
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	2 900	180
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 4,750 % éch. 21/01/2027	IDR	2 880 000	180
Obligation internationale du gouvernement de République tchèque 2,400 % éch. 17/09/2025	CZK	4 800	180
Émission d'investissement du gouvernement malaisien 4,130 % éch. 09/07/2029	MYR	850	177
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 8,750 % éch. 28/02/2048	ZAR	3 900	169
Obligation internationale du gouvernement roumain 3,250 % éch. 29/04/2024	RON	800	151
Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 08/02/2023	ILS	500	143
Obligation internationale du gouvernement israélien 0,150 % éch. 31/07/2023		500	140
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 9,750 % éch. 21/01/2027	BRL	750	132
Colombian TES 6,250 % éch. 26/11/2025	COP	735 300	127
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 9,000 % éch. 08/07/2024	HUF	50 000	121
Banque de développement asiatique 6,000 % éch. 05/02/2026	BRL	750	120
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 4,500 % éch. 22/01/2026	ZAR	2 200	118
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 6,500 % éch. 28/02/2041		3 000	110
Banque européenne pour la reconstruction et le développement 3,010 % éch. 13/03/2028	PLN	600	108
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,390 % éch. 17/06/2037	THB	3 900	104
Obligation internationale du gouvernement de République tchèque 0,050 % éch. 29/11/2029	CZK	3 400	102
Banque de développement asiatique 4,700 % éch. 12/03/2024	MXN	2 200	99
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 8,000 % éch. 31/01/2030	ZAR	1 900	97
Obligation internationale du gouvernement mexicain 8,500 % éch. 18/11/2038	MXN	2 100	97
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,350 % éch. 17/06/2033	THB	3 438	96
Obligation internationale du gouvernement indonésien 8,750 % éch. 15/05/2031	IDR	1 386 000	95
Obligation internationale du gouvernement indonésien 8,250 % éch. 15/05/2036		1 335 000	94
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,582 % éch. 15/07/2032	MYR	410	90
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,625 % éch. 25/07/2025	PLN	500	89
Obligation internationale du gouvernement polonais 2,500 % éch. 25/07/2026		500	85
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 8,250 % éch. 31/03/2032	ZAR	1 700	84
Obligation internationale du gouvernement hongrois 4,500 % éch. 27/05/2032	HUF	46 600	83
Banque européenne pour la reconstruction et le développement 5,080 % éch. 15/12/2025	MXN	1 900	82
Obligation internationale du gouvernement malaisien 2,632 % éch. 15/04/2031	MYR	400	81
Obligation internationale du gouvernement de République tchèque 2,000 % éch. 13/10/2033	CZK	2 300	76
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,125 % éch. 17/12/2026	THB	2 600	70
Obligation internationale du gouvernement péruvien 6,350 % éch. 12/08/2028	PEN	300	70
République de Colombie 1,000 % éch. 26/11/2025	COP	418 100	70
Obligation internationale du gouvernement indonésien 6,375 % éch. 15/04/2042	IDR	1 175 000	70
République de Colombie 1,000 % éch. 26/11/2025	COP	418 200	70
République de Colombie 1,000 % éch. 26/11/2025		418 100	69
Obligation internationale du gouvernement uruguayen 8,500 % éch. 15/03/2028	UYU	3 200	69
République de Colombie 1,000 % éch. 26/11/2025	COP	418 200	68
République de Colombie 1,000 % éch. 26/11/2025		418 100	68

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022			
Obligation internationale du gouvernement malaisien 4,837 % éch. 15/07/2025	MYR	900	$ 209
Colombian TES 6,250 % éch. 26/11/2025	COP	735 300	131
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 9,000 % éch. 08/07/2024	HUF	50 000	120
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 1,585 % éch. 17/12/2035	THB	4 504	100
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 3,350 % éch. 17/06/2033		2 630	80
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,125 % éch. 17/12/2026		2 600	74
République de Colombie 1,000 % éch. 26/11/2025	COP	418 100	72
République de Colombie 1,000 % éch. 26/11/2025		418 100	70
République de Colombie 1,000 % éch. 26/11/2025		418 200	70
République de Colombie 1,000 % éch. 26/11/2025		418 200	69
République de Colombie 1,000 % éch. 26/11/2025		418 100	68
Obligation internationale du gouvernement indonésien 6,375 % éch. 15/08/2028	IDR	1 042 000	66
Émission d'investissement du gouvernement malaisien 4,369 % éch. 31/10/2028	MYR	290	63
Obligation internationale du gouvernement mexicain 7,500 % éch. 03/06/2027	MXN	1 300	62
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 4,875 % éch. 22/06/2029	THB	1 600	54
Obligation internationale du gouvernement polonais 3,750 % éch. 25/05/2027	PLN	300	52
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 8,000 % éch. 31/01/2030	ZAR	900	48
Banque interaméricaine de développement 5,500 % éch. 07/02/2023	IDR	610 000	39
Obligation internationale du gouvernement malaisien 2,632 % éch. 15/04/2031	MYR	200	38
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,000 % éch. 17/06/2042	THB	1 520	32
Obligation internationale du gouvernement malaisien 4,696 % éch. 15/10/2042	MYR	100	22
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,582 % éch. 15/07/2032		90	20
Obligation internationale du gouvernement polonais 1,750 % éch. 25/04/2032	PLN	150	19

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Emerging Markets Bond Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		117 315 602	$	1 167 346
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042	$	113 500		112 064
Billets du Trésor américain 3,125 % éch. 31/08/2029		52 000		50 309
		ACTIONS		
PIMCO Global Investors Series PLC - Fonds Emerging Markets Opportunities Fund (a)		4 473 752		43 950
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S 7,250 % éch. 24/02/2027	$	34 400		34 400
Obligation internationale du gouvernement israélien 1,500 % éch. 30/11/2023	ILS	108 000		31 232
Billets du Trésor américain 2,625 % éch. 31/07/2029	$	30 000		29 947
Republic of Angola Via Avenir Issuer Ireland DAC 6,927 % éch. 19/02/2027		27 212		25 335
Gaci First Investment Co. 5,000 % éch. 13/10/2027		22 200		21 993
Obligations du Trésor américain 2,375 % éch. 15/02/2042		25 000		21 225
Obligation internationale du gouvernement angolais 8,750 % éch. 14/04/2032		20 500		20 470
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	330 100		20 245
Obligation internationale du gouvernement chilien 4,340 % éch. 07/03/2042	$	19 800		19 196
Obligation internationale du gouvernement hongrois 5,250 % éch. 16/06/2029		17 800		17 585
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 5,500 % éch. 22/02/2029		18 100		17 528
Corsair International Ltd. 5,473 % éch. 28/01/2027	€	15 600		17 416
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 5,063 % éch. 12/09/2025	$	16 500		16 500
Obligation internationale du gouvernement du Guatemala 5,250 % éch. 10/08/2029		16 500		16 310
Qatar Energy 3,300 % éch. 12/07/2051		22 900		16 115
BOI Finance BV 7,500 % éch. 16/02/2027	€	14 400		15 996

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		157 831 793	$	1 570 551
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S 7,250 % éch. 24/02/2027	$	34 400		34 017
		ACTIONS		
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds PIMCO Asia High Yield Bond Fund (a)		3 053 291		28 396
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligation internationale du gouvernement ukrainien 7,750 % éch. 01/09/2024	$	26 600		25 689
Obligation internationale du gouvernement chilien 3,100 % éch. 07/05/2041		27 300		24 316
Chalco Hong Kong Investment Co. Ltd. 2,100 % éch. 28/07/2026		23 800		21 419
Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 5,250 % éch. 22/03/2030	€	22 250		20 501
		ACTIONS		
PIMCO Global Investors Series PLC - Fonds Emerging Markets Opportunities Fund (a)		2 116 402		20 000
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligation internationale du gouvernement angolais 8,750 % éch. 14/04/2032	$	20 200		19 828
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT 5,450 % éch. 15/05/2030		16 800		17 917
Obligation internationale du gouvernement d'Équateur 2,500 % éch. 31/07/2035		27 400		17 444
Obligation internationale du gouvernement nigérian 8,747 % éch. 21/01/2031		20 850		16 863
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 3,750 % éch. 21/01/2055		22 200		16 608
Obligation internationale du gouvernement argentin 1,500 % éch. 09/07/2035		81 200		16 430
SPIC MTN Co. Ltd. 1,625 % éch. 27/07/2025		17 000		16 028
MAF Sukuk Ltd. 4,638 % éch. 14/05/2029		15 000		13 915
KSA Sukuk Ltd. 2,250 % éch. 17/05/2031		14 100		13 265
Obligation internationale du gouvernement indonésien 6,750 % éch. 15/01/2044		9 650		13 191
Obligation internationale du gouvernement égyptien 7,600 % éch. 30/06/2029		13 700		13 084
Petronas Capital Ltd. 3,404 % éch. 28/04/2061		17 000		12 583

(a) Le Fonds Emerging Markets Bond Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042	$	66 400	$	65 747
Billets du Trésor américain 3,125 % éch. 31/08/2029		37 800		36 571
Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 08/02/2023	ILS	116 500		33 360
Obligation internationale du gouvernement israélien 1,500 % éch. 30/11/2023		89 900		25 418
Obligations du Trésor américain 3,375 % éch. 15/08/2042	$	25 500		22 311
Obligation internationale du gouvernement israélien 0,150 % éch. 31/07/2023	ILS	79 600		21 935
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S 7,250 % éch. 24/02/2027	$	20 300		20 300
Obligation internationale du gouvernement d'Équateur 2,500 % éch. 31/07/2035		32 700		18 538
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia 4,700 % éch. 06/06/2032		16 900		16 900
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	241 200		14 793
Obligation internationale du gouvernement kazakh 6,500 % éch. 21/07/2045	$	13 700		14 456
Obligation internationale du gouvernement panaméen 4,500 % éch. 19/01/2063		14 500		14 409
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 5,875 % éch. 20/04/2032		13 500		13 500
Obligation internationale du gouvernement chilien 2,750 % éch. 31/01/2027		13 100		13 009
Fondo MIVIVIENDA S.A. 4,625 % éch. 12/04/2027		13 000		12 955
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 5,500 % éch. 22/02/2029		12 400		12 064
Obligation internationale du gouvernement indonésien 5,250 % éch. 17/01/2042		11 400		12 027
Santander Holdings USA, Inc. 5,807 % éch. 09/09/2026		12 000		12 000
Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % éch. 21/01/2032		11 700		11 701
1MDB Global Investments Ltd. 4,400 % éch. 09/03/2023		12 200		11 699
Obligation internationale du gouvernement hongrois 5,250 % éch. 16/06/2029		11 600		11 460
Obligation internationale du gouvernement kenyan 6,875 % éch. 24/06/2024		12 900		11 146
Obligation internationale du gouvernement polonais 5,500 % éch. 16/11/2027		11 100		11 043
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 7,300 % éch. 20/04/2052		11 000		11 000
Obligation internationale du gouvernement hongrois 5,000 % éch. 22/02/2027	€	10 600		10 817
Obligation internationale du gouvernement chilien 4,340 % éch. 07/03/2042	$	10 700		10 691

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
Obligation internationale du gouvernement égyptien 5,250 % éch. 06/10/2025	$	22 400	$	20 520
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama A/S 7,250 % éch. 24/02/2027		20 300		20 097
Obligation internationale du gouvernement d'Équateur 5,500 % éch. 31/07/2030		13 200		11 450
Obligation internationale du gouvernement indonésien 4,350 % éch. 11/01/2048		11 400		11 022
Obligation internationale du gouvernement mongol 4,450 % éch. 07/07/2031		12 200		10 885
Obligation internationale du gouvernement indonésien 5,250 % éch. 17/01/2042		10 300		10 467
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 5,950 % éch. 25/01/2027		10 000		9 532
Obligation internationale du gouvernement kenyan 8,000 % éch. 22/05/2032		11 400		9 262
Obligation internationale du gouvernement ukrainien 7,750 % éch. 01/09/2024		9 100		8 703
Kookmin Bank 1,375 % éch. 06/05/2026		9 400		8 510
Shinhan Bank Co. Ltd. 1,375 % éch. 21/10/2026		9 000		8 069
Obligation internationale du gouvernement hongrois 7,625 % éch. 29/03/2041		7 200		7 984
Absa Group Ltd. 6,375 % éch. 27/05/2026		8 100		7 571
Obligation internationale du gouvernement sénégalais 6,250 % éch. 23/05/2033		9 000		7 492
UltraTech Cement Ltd. 2,800 % éch. 16/02/2031		8 000		7 491
Obligation internationale du gouvernement jordanien 7,375 % éch. 10/10/2047		10 000		7 323
Obligation internationale du gouvernement uruguayen 4,375 % éch. 23/01/2031		6 604		7 116
Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 5,250 % éch. 22/03/2030	€	7 300		6 728
Obligation internationale du gouvernement kazakh 1,550 % éch. 09/11/2023		6 740		6 459
MercadoLibre, Inc. 2,375 % éch. 14/01/2026	$	7 300		6 244
Klabin Austria GmbH 3,200 % éch. 12/01/2031		7 200		6 200
Azure Power Energy Ltd. 3,575 % éch. 19/08/2026		9 119		6 158
Akbank T.A.S. 6,800 % éch. 22/06/2031		6 500		6 135
Obligation internationale du gouvernement chilien 3,500 % éch. 31/01/2034		6 900		6 112
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 4,875 % éch. 23/09/2032		7 500		6 088
Turkiye Vakiflar Bankasi TAO 5,500 % éch. 01/10/2026		6 800		6 061
Obligation internationale du gouvernement israélien 3,800 % éch. 13/05/2060		5 500		5 725
Obligation internationale du gouvernement argentin 1,500 % éch. 09/07/2035		28 100		5 500

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		9 334 287	$	92 889
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 3,750 % éch. 09/05/2027	€	2 100		2 159
Samba Funding Ltd. 2,900 % éch. 29/01/2027	$	1 700		1 717
Obligation internationale du gouvernement israélien 1,500 % éch. 30/11/2023	ILS	6 000		1 647
LG Chem Ltd. 3,625 % éch. 15/04/2029	$	1 600		1 532
Fab Sukuk Co. Ltd. 3,875 % éch. 22/01/2024		1 500		1 513
Saudi Arabian Oil Co. 4,250 % éch. 16/04/2039		1 500		1 439
Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % éch. 21/01/2032		1 400		1 303
Israel Electric Corp. Ltd. 3,750 % éch. 22/02/2032		1 200		1 175
NBK SPC Ltd. 1,625 % éch. 15/09/2027		1 200		1 075
Banco de Chile 2,990 % éch. 09/12/2031		1 200		1 037
CT Trust 5,125 % éch. 03/02/2032		1 000		960
Bangkok Bank PCL 3,733 % éch. 25/09/2034		1 200		955
Kookmin Bank 2,500 % éch. 04/11/2030		1 100		937
Freeport Indonesia PT 4,763 % éch. 14/04/2027		900		900
First Abu Dhabi Bank PJSC 5,125 % éch. 13/10/2027		900		894
Reliance Industries Ltd. 2,875 % éch. 12/01/2032		900		848
Obligation internationale du gouvernement israélien 0,150 % éch. 31/07/2023	ILS	2 700		754
Obligation internationale du gouvernement chilien 4,340 % éch. 07/03/2042	$	900		739
Energean Israel Finance Ltd. 5,375 % éch. 30/03/2028		800		728

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		8 742 329	$	87 000
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	35 500		2 341
Gazprom Neft OAO Via GPN Capital S.A. 6,000 % éch. 27/11/2023	$	2 200		2 295
Lukoil Securities BV 3,875 % éch. 06/05/2030		2 000		1 418
Saudi Arabian Oil Co. 2,875 % éch. 16/04/2024		1 400		1 385
Lenovo Group Ltd. 5,875 % éch. 24/04/2025		1 300		1 346
Gazprom PJSC Via Gaz Capital S.A. 4,950 % éch. 23/03/2027		1 800		1 328
BBVA Bancomer S.A. 5,125 % éch. 18/01/2033		1 450		1 293
Banco BTG Pactual S.A. 4,500 % éch. 10/01/2025		1 300		1 261
BRF S.A. 4,875 % éch. 24/01/2030		1 300		1 118
Zoomlion HK SPV Co. Ltd. 6,125 % éch. 20/12/2022		1 100		1 105
Turkiye Sise ve Cam Fabrikalari A/S 6,950 % éch. 14/03/2026		1 100		1 075
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 3,750 % éch. 23/01/2023		1 000		998
CSN Inova Ventures 6,750 % éch. 28/01/2028		1 000		992
Altice Financing S.A. 2,250 % éch. 15/01/2025	€	900		952
Tullow Oil PLC 10,250 % éch. 15/05/2026	$	900		920
Sands China Ltd. 4,875 % éch. 18/06/2030		1 100		901
Akbank T.A.S. 6,800 % éch. 06/02/2026		1 000		888
Kuwait Projects Co. SPC Ltd. 4,500 % éch. 23/02/2027		900		822
First Quantum Minerals Ltd. 6,875 % éch. 15/10/2027		900		819

(a) Le Fonds Emerging Markets Corporate Bond Fund investit dans des actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille
Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		12 029 117	$ 119 731
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Obligations du Trésor américain 2,375 % éch. 15/02/2042	$	24 500	23 653
Colombian TES 6,250 % éch. 26/11/2025	COP	66 459 700	12 444
Obligation internationale du gouvernement singapourien 2,875 % éch. 01/07/2029	SGD	16 052	12 395
Obligations du Trésor américain 1,750 % éch. 15/08/2041	$	11 000	7 523
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	102 900	6 292
Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,500 % éch. 04/03/2027	MXN	133 000	5 872
Obligation internationale du gouvernement israélien 0,150 % éch. 31/07/2023	ILS	20 800	5 718
Billets du Trésor américain 2,500 % éch. 30/04/2024	$	5 600	5 586
Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 07/10/2022	ILS	19 000	5 530
Obligations du Trésor américain 3,375 % éch. 15/08/2042	$	4 000	4 023
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 8,000 % éch. 31/01/2030	ZAR	75 100	3 878
Empresa de los Ferrocarriles del Estado 3,068 % éch. 18/08/2050	$	5 100	3 689
Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 08/02/2023	ILS	11 000	3 187
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 5,300 % éch. 21/01/2041	$	3 700	3 105
Obligation internationale du gouvernement israélien 1,250 % éch. 30/11/2022	ILS	9 300	2 952
Vale S.A. 0,000 % éch. 29/12/2049	BRL	29 580	2 941
Mong Duong Finance Holdings BV 5,125 % éch. 07/05/2029	$	2 800	2 548
Trust Fibra Uno 6,390 % éch. 15/01/2050		2 500	2 535
LLPL Capital Pte. Ltd. 6,875 % éch. 04/02/2039		2 528	2 534

DESCRIPTION		ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		12 066 556	$ 120 100
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Obligation internationale du gouvernement singapourien 2,875 % éch. 01/07/2029	SGD	16 052	11 846
Colombian TES 6,250 % éch. 26/11/2025	COP	67 871 500	11 118
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	171 200	10 513
Obligation internationale du gouvernement singapourien 3,375 % éch. 01/09/2033	SGD	10 200	8 362
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 5,000 % éch. 01/10/2028	CLP	6 670 000	7 289
Obligation internationale du gouvernement mexicain 5,500 % éch. 04/03/2027	MXN	133 000	5 603
Obligation internationale du gouvernement de l'Émirat de Dubaï 3,900 % éch. 09/09/2050	$	4 700	3 956
Obligation internationale du gouvernement d'Équateur 5,500 % éch. 31/07/2030		4 000	3 493
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 5,300 % éch. 21/01/2041		4 500	3 434
Empresa de los Ferrocarriles del Estado 3,068 % éch. 18/08/2050		5 100	2 983
Obligation internationale du gouvernement israélien 1,250 % éch. 30/11/2022	ILS	9 300	2 814
Obligation internationale du gouvernement péruvien 6,900 % éch. 12/08/2037	PEN	11 800	2 757
LLPL Capital Pte. Ltd. 6,875 % éch. 04/02/2039	$	2 528	2 414
Obligation internationale du gouvernement roumain 2,500 % éch. 08/02/2030	€	2 500	2 400
Guara Norte SARL 5,198 % éch. 15/06/2034	$	2 528	2 123
Midwest Connector Capital Co. LLC 3,900 % éch. 01/04/2024		2 000	2 070
T-Mobile USA, Inc. 3,600 % éch. 15/11/2060		2 600	1 998
Obligation internationale du gouvernement du Ghana 8,875 % éch. 07/05/2042		3 600	1 998
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,700 % éch. 01/09/2030	CLP	1 900 000	1 968

(a) Le Fonds PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022			
Colombian TES 6,250 % éch. 26/11/2025	COP	5 775 400	$ 1 080
Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 07/10/2022	ILS	3 600	1 048
		ACTIONS	
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		70 373	700
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 08/02/2023	ILS	2 100	608
Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 03/05/2023		1 600	460
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	5 100	321
Colombian TES 5,750 % éch. 03/11/2027	COP	1 439 700	253
Lloyds Banking Group PLC 4,716 % éch. 11/08/2026	$	200	200
Development Bank of Kazakhstan JSC 4,125 % éch. 10/12/2022		200	200
Steas Funding DAC 7,230 % éch. 17/03/2026		200	199
Flourish Century 6,600 % éch. 04/02/2049		200	194
Obligation internationale du gouvernement de République tchèque 2,500 % éch. 25/08/2028	CZK	4 600	167
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 5,800 % éch. 01/06/2024	CLP	130 000	161
Colombian TES 7,500 % éch. 26/08/2026	COP	691 000	154
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 2,000 % éch. 31/01/2025	ZAR	2 466	151
Obligation internationale du gouvernement israélien 1,500 % éch. 30/11/2023	ILS	500	145
Harbour Energy PLC 3,944 % éch. 28/01/2054	£	100	129
Colombian TES 9,250 % éch. 28/05/2042	COP	754 600	115
Corsair International Ltd. 5,473 % éch. 28/01/2027	€	100	112
Obligation internationale du gouvernement israélien 0,150 % éch. 31/07/2023	ILS	400	109
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,500 % éch. 01/03/2026	CLP	90 000	107
République de Colombie 1,000 % éch. 26/11/2025	COP	536 100	107
Obligation internationale du gouvernement hongrois 5,000 % éch. 22/02/2027	€	100	102
Rio Oil Finance Trust 9,250 % éch. 06/07/2024	$	89	96
Obligation internationale du gouvernement israélien 4,250 % éch. 31/03/2023	ILS	300	88

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022			
Colombian TES 6,250 % éch. 26/11/2025	COP	6 927 400	$ 1 271
Colombian TES 5,750 % éch. 03/11/2027		5 681 700	1 007
		ACTIONS	
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		80 385	800
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	8 800	525
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 2,500 % éch. 01/03/2025	CLP	430 000	464
		ACTIONS	
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		3 900	386
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 5,000 % éch. 01/10/2028	CLP	255 000	291
		ACTIONS	
PIMCO Specialty Funds Ireland p.l.c. - Fonds PIMCO China Bond Fund (a)		16 369	220
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Banco Santander S.A. 6,750 % éch. 25/04/2022	€	200	219
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	3 600	209
MAF Global Securities Ltd. 4,750 % éch. 07/05/2024	$	200	206
Growthpoint Properties International Pty. Ltd. 5,872 % éch. 02/05/2023		200	201
BOC Aviation Ltd. 2,750 % éch. 18/09/2022		200	200
Banco BTG Pactual S.A. 4,500 % éch. 10/01/2025		200	197
Obligation internationale du gouvernement égyptien 14,605 % éch. 08/09/2025	EGP	3 100	196
Sands China Ltd. 5,625 % éch. 08/08/2025	$	200	195
DAE Funding LLC 1,550 % éch. 01/08/2024		200	187
Obligation internationale du gouvernement zambien 13,000 % éch. 25/01/2031	ZMW	5 400	180
Health & Happiness H&H International Holdings Ltd. 5,625 % éch. 24/10/2024	$	200	174
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,500 % éch. 01/03/2026	CLP	150 000	173
Option One Mortgage Loan Trust 4,529 % éch. 25/03/2037	$	256	164
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 5,800 % éch. 01/06/2024	CLP	130 000	152
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,700 % éch. 01/09/2030		135 000	150
Colombian TES 7,500 % éch. 26/08/2026	COP	691 000	126
Obligation internationale du gouvernement ukrainien 7,750 % éch. 01/09/2024	$	200	118
République de Colombie 1,000 % éch. 26/11/2025	COP	536 100	104

(a) Le Fonds Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds PIMCO ESG Income Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022			
Banque internationale pour la reconstruction et le développement 3,000 % éch. 27/09/2023	$	10 950	$ 11 353
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2032 (a)		6 630	5 852
EMF-UK PLC 4,491 % éch. 13/03/2046	£	3 566	4 219
Towd Point Mortgage Funding PLC 3,596 % éch. 20/10/2051		3 000	3 556
Banque de développement asiatique 6,550 % éch. 26/01/2025	ZAR	42 000	2 746
Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/09/2029	$	2 400	2 397
Billets du Trésor américain 2,375 % éch. 31/03/2029		2 100	2 083
280 Park Avenue Mortgage Trust 5,317 % éch. 15/09/2034		2 000	1 941
Commercial Mortgage Trust 3,832 % éch. 10/02/2036		2 000	1 828
Madison Avenue Mortgage Trust 3,976 % éch. 15/08/2034		1 770	1 705
Long Beach Mortgage Loan Trust 4,699 % éch. 25/08/2036		2 727	1 618
Barclays Commercial Mortgage Securities Trust 4,498 % éch. 10/08/2035		1 600	1 562
GSAMP Trust 4,869 % éch. 25/06/2036		2 105	1 500
1211 Avenue of the Americas Trust 4,142 % éch. 10/08/2035		1 595	1 491
InTown Hotel Portfolio Trust 2,775 % éch. 15/01/2033		1 325	1 316
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 4,679 % éch. 25/07/2036		1 306	1 311
Structured Asset Investment Loan Trust 5,364 % éch. 25/05/2035		1 405	1 311
First Franklin Mortgage Loan Trust 4,129 % éch. 25/03/2036		1 446	1 311
Downey Savings & Loan Association Mortgage Loan Trust 4,479 % éch. 19/03/2037		1 475	1 291
Bear Stearns Asset-Backed Securities Trust 4,889 % éch. 25/08/2036		1 287	1 219
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 3,917 % éch. 15/11/2032		1 200	1 204
Liberty Street Trust 4,501 % éch. 10/02/2036		1 100	1 072
Wells Fargo Home Equity Asset-Backed Securities Trust 5,389 % éch. 25/10/2034		1 051	1 012
NXP BV 5,000 % éch. 15/01/2033		1 000	997
Indian Railway Finance Corp. Ltd. 3,570 % éch. 21/01/2032		950	950

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022			
Obligation internationale du gouvernement philippin 4,200 % éch. 29/03/2047	$	650	$ 680
Sunnova Energy Corp. 5,875 % éch. 01/09/2026		550	518
UBS AG 5,125 % éch. 15/05/2024		500	506
VICI Properties LP 3,500 % éch. 15/02/2025		500	472
Berkeley Group PLC 2,500 % éch. 11/08/2031	£	650	444
Cyrusone Europe Finance DAC 1,125 % éch. 26/05/2028	€	400	435
Azure Power Solar Energy Pvt Ltd. 5,650 % éch. 24/12/2024	$	400	402
Sunny Optical Technology Group Co. Ltd. 3,750 % éch. 23/01/2023		400	401
NextEra Energy Operating Partners LP 4,250 % éch. 15/07/2024		400	400
Valeo 1,000 % éch. 03/08/2028	€	400	347
Northern States Power Co. 4,500 % éch. 01/06/2052	$	300	309
Lloyds Banking Group PLC 7,625 % éch. 27/06/2023	£	200	274
Duke Energy Carolinas LLC 3,550 % éch. 15/03/2052	$	330	272
Ford Motor Credit Co. LLC 3,096 % éch. 04/05/2023		200	199
MAF Sukuk Ltd. 3,933 % éch. 28/02/2030		200	194
Boral Finance Pty. Ltd. 3,750 % éch. 01/05/2028		200	191
Public Service Co. of Oklahoma 2,200 % éch. 15/08/2031		200	171
Broadstone Net Lease LLC 2,600 % éch. 15/09/2031		200	143
Marks & Spencer PLC 4,500 % éch. 10/07/2027	£	100	140
Azure Power Energy Ltd. 3,575 % éch. 19/08/2026	$	186	136

(a) Le montant principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Euro Bond Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		2 289 800	€	220 293
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			
Obligation internationale du gouvernement espagnol 0,000 % éch. 31/01/2026	€	78 400		75 783
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 01/03/2023	¥	9 056 000		62 795
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2031	€	43 464		50 840
Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 22/11/2027	£	35 301		49 818
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 14/11/2022	¥	5 830 000		42 575
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 24/10/2022		5 880 000		42 264
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/10/2027 (b)	$	29 980		28 907
Obligation internationale du gouvernement belge 1,400 % éch. 22/06/2053	€	21 500		21 598
Obligation internationale du gouvernement espagnol 3,450 % éch. 30/07/2066		15 200		20 989
Bons du Trésor français 0,000 % éch. 04/01/2023		20 130		20 096
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3,850 % éch. 01/09/2049		16 300		18 883
Obligation internationale du gouvernement espagnol 2,550 % éch. 31/10/2032		18 400		18 608
Obligation internationale du gouvernement espagnol 1,900 % éch. 31/10/2052		19 200		18 482
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,000 % éch. 15/11/2029		17 100		16 959
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 2,150 % éch. 01/09/2052		19 000		15 523
Obligation internationale du gouvernement espagnol 0,100 % éch. 30/04/2031		18 000		15 465
Électricité de France S.A. 2,875 % éch. 15/12/2026		12 800		12 358
Ripon Mortgages PLC 4,011 % éch. 28/08/2056	£	8 600		10 237
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2038	€	9 287		10 088

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		2 109 500	€	203 097
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			
Obligation internationale du gouvernement espagnol 2,150 % éch. 31/10/2025	€	80 100		83 604
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,250 % éch. 15/03/2028		79 900		67 436
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	458 100		47 808
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2031	€	41 716		45 767
Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 22/11/2027	£	35 795		41 687
Obligation internationale du gouvernement espagnol 1,400 % éch. 30/07/2028	€	39 700		40 495
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2030 (b)	$	31 915		30 374
Obligation internationale du gouvernement espagnol 1,450 % éch. 31/10/2027	€	29 500		28 120
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 10/03/2029	¥	3 469 624		27 423
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2031 (b)	$	28 558		27 361
Obligation internationale du gouvernement espagnol 1,950 % éch. 30/04/2026	€	23 700		23 988
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	208 458		23 650
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % éch. 15/05/2030	€	22 750		23 481
Obligation internationale du gouvernement espagnol 0,800 % éch. 30/07/2027		23 500		22 386
CVC Cordatus Loan Fund DAC 2,112 % éch. 21/07/2030		23 013		22 346
Obligation internationale du gouvernement français 0,750 % éch. 25/05/2052		23 000		20 229
Bons du Trésor français 0,000 % éch. 04/01/2023		20 130		20 117
Obligation internationale du gouvernement espagnol 1,000 % éch. 31/10/2050		22 000		17 486
Jyske Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	150 450		17 289
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,000 % éch. 15/09/2028	€	18 500		16 406
Ares European CLO DAC 2,158 % éch. 15/10/2031		15 300		14 726
Dexia Credit Local S.A. 0,000 % éch. 29/05/2024		14 600		14 673
Obligation internationale du gouvernement espagnol 1,450 % éch. 31/10/2071		17 771		13 648

(a) Le Fonds Euro Bond Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Euro Credit Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		664 000	€	64 198
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Goldman Sachs Group, Inc. 0,875 % éch. 09/05/2029	€	19 900		19 024
Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. 0,625 % éch. 19/11/2027		15 400		15 300
Wells Fargo & Co. 1,000 % éch. 02/02/2027		14 900		15 101
Santander UK Group Holdings PLC 0,603 % éch. 13/09/2029		10 100		9 851
BNP Paribas S.A. 1,904 % éch. 30/09/2028	$	10 400		8 809
Barclays PLC 0,577 % éch. 09/08/2029	€	9 000		8 750
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 3,875 % éch. 20/09/2027		8 400		8 369
Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % éch. 05/09/2027		6 500		6 500
ABN AMRO Bank NV 2,375 % éch. 01/06/2027		6 200		6 178
ABN AMRO Bank NV 2,470 % éch. 13/12/2029	$	7 100		6 141
easyJet FinCo BV 1,875 % éch. 03/03/2028	€	6 000		6 059
SBB Treasury Oyj 2,284 % éch. 08/02/2024		6 000		6 007
JAB Holdings BV 4,750 % éch. 29/06/2032		5 600		5 600
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,138 % éch. 14/09/2028	$	5 400		5 452
Atlantia SpA 1,875 % éch. 12/02/2028	€	5 200		5 213
Balder Finland Oyj 1,375 % éch. 24/05/2030		5 300		5 128
Global Switch Holdings Ltd. 1,500 % éch. 31/01/2024		4 800		4 832
CPI Property Group S.A. 1,500 % éch. 27/01/2031		5 000		4 810
Société Générale S.A. 1,792 % éch. 09/06/2027	$	5 600		4 768
CaixaBank S.A. 3,750 % éch. 07/09/2029	€	4 500		4 470
Vilmorin & Cie S.A. 1,375 % éch. 26/03/2028		4 400		4 400
Chanel Ceres PLC 0,500 % éch. 31/07/2026		4 300		4 288
Lloyds Banking Group PLC 3,750 % éch. 18/03/2028	$	4 600		4 216
GN Store Nord A/S 0,875 % éch. 25/11/2024	€	4 000		4 024
P3 Group SARL 1,625 % éch. 26/01/2029		4 000		3 968
JDE Peet's NV 0,500 % éch. 16/01/2029		4 750		3 896
Dutch Property Finance BV 2,328 % éch. 28/10/2059		3 700		3 689

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		785 000	€	75 940
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Goldman Sachs Group, Inc. 1,375 % éch. 15/05/2024	€	18 700		18 962
ABN AMRO Bank NV 2,470 % éch. 13/12/2029	$	17 200		14 207
HSBC Holdings PLC 3,973 % éch. 22/05/2030		17 000		14 205
Wells Fargo & Co. 1,625 % éch. 02/06/2025	€	12 400		12 933
Santander UK Group Holdings PLC 3,625 % éch. 14/01/2026	£	10 000		12 763
Goldman Sachs Group, Inc. 0,875 % éch. 09/05/2029	€	11 800		10 311
BNP Paribas S.A. 4,705 % éch. 10/01/2025	$	9 700		9 843
Société Générale S.A. 0,875 % éch. 22/09/2028	€	11 600		9 739
Crédit Agricole S.A. 0,500 % éch. 21/09/2029		10 400		9 060
BPCE S.A. 1,000 % éch. 01/04/2025		8 900		8 465
BNP Paribas S.A. 0,250 % éch. 13/04/2027		9 000		8 294
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA 3,875 % éch. 20/09/2027		8 400		8 204
Barclays PLC 3,125 % éch. 17/01/2024	£	6 000		7 397
Lloyds Banking Group PLC 1,875 % éch. 15/01/2026		5 400		6 492
Ares European CLO DAC 2,582 % éch. 21/10/2033	€	6 600		6 458
UniCredit SpA 2,200 % éch. 22/07/2027		6 700		6 376
Morgan Stanley 1,342 % éch. 23/10/2026		6 300		6 275
Morgan Stanley 1,000 % éch. 02/12/2022		6 000		6 053
Conti-Gummi Finance BV 1,125 % éch. 25/09/2024		6 000		6 006

(a) Le Fonds Euro Credit Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Euro Income Bond Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		2 346 000	€	225 890
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Barclays PLC 7,437 % éch. 02/11/2033	$	11 850		12 102
Goldman Sachs Group, Inc. 1,250 % éch. 07/02/2029	€	9 762		9 731
P3 Group SARL 1,625 % éch. 26/01/2029		9 800		9 721
Société Générale S.A. 2,226 % éch. 21/01/2026	$	11 000		9 700
Société Générale S.A. 2,797 % éch. 19/01/2028		10 800		9 523
Bank of America Corp. 1,000 % éch. 24/07/2026		9 400		9 173
Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % éch. 21/11/2033		9 025		8 939
Bon du Trésor britannique 0,500 % éch. 22/07/2022	£	7 200		8 606
Toro European CLO DAC 2,239 % éch. 12/01/2032	€	8 700		8 548
Ford Motor Credit Co. LLC 4,125 % éch. 17/08/2027	$	9 200		8 494
Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % éch. 05/09/2027	€	8 300		8 300
Dutch Property Finance BV 2,328 % éch. 28/10/2059		7 400		7 379
Westpac Banking Corp. 3,106 % éch. 23/11/2027		7 300		7 300
Digital Intrepid Holding BV 1,375 % éch. 18/07/2032		7 500		7 273
Obligation internationale du gouvernement français 0,000 % éch. 25/03/2023		7 150		7 115
TDC Net A/S 5,056 % éch. 31/05/2028		7 000		7 041
easyJet FinCo BV 1,875 % éch. 03/03/2028		6 500		6 566
Balder Finland Oyj 2,000 % éch. 18/01/2031		6 500		6 478
DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % éch. 25/01/2027		6 400		6 366
Jubilee Place BV 2,228 % éch. 17/01/2059		6 300		6 329
Wells Fargo & Co. 4,540 % éch. 15/08/2026	$	6 450		6 313
Carlyle Euro CLO DAC 2,428 % éch. 15/08/2030	€	6 384		6 297

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		1 915 900	€	184 960
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds US Short-Term Fund (a)		8 755 553		81 965
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	334 982		34 792
BNP Paribas S.A. 4,705 % éch. 10/01/2025	$	30 500		30 429
Jyske Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	233 848		27 345
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050		224 800		26 089
Aeroporti di Roma SpA 5,441 % éch. 20/02/2023	£	15 000		18 581
INEOS Finance PLC 1,000 % éch. 08/11/2027	€	18 984		18 511
INEOS Finance PLC 3,898 % éch. 01/04/2024		18 984		18 414
Goldman Sachs Group, Inc. 0,875 % éch. 09/05/2029		19 400		17 942
Obligation internationale du gouvernement omanais 4,875 % éch. 01/02/2025	$	18 900		17 292
Stratton Mortgage Funding PLC 3,826 % éch. 20/07/2060	£	12 926		15 425
InterContinental Hotels Group PLC 1,625 % éch. 08/10/2024	€	14 900		15 125
Casino Guichard Perrachon S.A. 5,340 % éch. 31/08/2025		16 500		14 460
Jaguar Land Rover Automotive PLC 3,875 % éch. 01/03/2023	£	12 600		14 445
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA 3,625 % éch. 24/09/2024	€	14 800		14 267
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2053	DKK	113 874		14 074
Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 5,250 % éch. 22/03/2030	€	14 400		14 000
ABN AMRO Bank NV 2,470 % éch. 13/12/2029	$	16 500		13 878
Jyske Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2053	DKK	128 289		13 850

(a) Le Fonds Euro Income Bond Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Euro Long Average Duration Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		194 000	€	18 570
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligation internationale du gouvernement français 0,750 % éch. 25/05/2052	€	15 000		12 131
République d'Allemagne 0,000 % éch. 15/08/2052		7 700		6 588
Bon du Trésor britannique 1,000 % éch. 22/04/2024	£	4 200		4 608
Obligation internationale du gouvernement français 4,000 % éch. 25/04/2055	€	2 200		3 621
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2031		2 509		2 995
Obligation internationale du gouvernement slovène 1,500 % éch. 25/03/2035		2 400		2 377
Obligation internationale du gouvernement néerlandais 4,000 % éch. 15/01/2037		1 900		2 324
Obligation internationale du gouvernement néerlandais 0,000 % éch. 15/01/2052		3 900		2 170
Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 30/01/2026	£	1 900		1 956
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/10/2027 (b)	$	2 005		1 935
Obligation internationale du gouvernement néerlandais 0,000 % éch. 15/01/2038	€	2 500		1 799
Obligation internationale du gouvernement français 0,500 % éch. 25/06/2044		2 200		1 780
Obligation internationale du gouvernement belge 1,400 % éch. 22/06/2053		1 500		1 482
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2032 (b)	$	1 517		1 478
Ministeries van de Vlaamse Gemeenschap 3,250 % éch. 12/01/2043	€	1 200		1 180
Obligation internationale du gouvernement français 4,000 % éch. 25/04/2060		750		1 179
Obligation internationale du gouvernement espagnol 1,900 % éch. 31/10/2052		900		869
Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 22/11/2032	£	439		829
Nykredit Realkredit A/S 3,500 % éch. 01/10/2053	DKK	6 100		805

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		142 100	€	13 506
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
République d'Allemagne 0,000 % éch. 15/08/2052	€	7 700		5 814
Bon du Trésor britannique 1,000 % éch. 22/04/2024	£	4 200		4 627
Obligation internationale du gouvernement français 1,500 % éch. 25/05/2050	€	4 150		4 191
République d'Allemagne 0,000 % éch. 15/08/2050		4 300		4 000
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 0,875 % éch. 04/07/2039		3 000		3 169
Obligation internationale du gouvernement français 0,750 % éch. 25/05/2052		4 200		3 142
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2031		2 523		2 982
Obligation internationale du gouvernement français 1,250 % éch. 25/05/2036		2 600		2 839
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 10/03/2029	¥	332 845		2 629
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2030 (b)	$	2 273		2 162
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	18 000		1 929
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050		14 370		1 625
Obligation internationale du gouvernement français 1,750 % éch. 25/06/2039	€	1 500		1 458
CVC Cordatus Loan Fund DAC 2,112 % éch. 21/07/2030		1 338		1 306
Jyske Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2053	DKK	12 898		1 276
Atlantia SpA 1,875 % éch. 12/02/2028	€	1 200		1 196
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % éch. 15/05/2030		972		999
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,000 % éch. 15/02/2048 (b)	$	944		945
Obligation internationale du gouvernement français 0,500 % éch. 25/06/2044	€	1 500		934

(a) Le Fonds Euro Long Average Duration Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		48 000	€	4 593
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
iliad S.A. 5,375 % éch. 14/06/2027	€	2 700		2 706
Intrum AB 9,250 % éch. 15/03/2028		2 400		2 328
Lorca Telecom Bondco S.A. 4,000 % éch. 18/09/2027		2 300		2 268
Lorca Holdco Ltd. 6,319 % éch. 17/09/2027		2 300		2 185
Intesa Sanpaolo SpA 8,248 % éch. 21/11/2033	$	2 100		2 084
Inter Media and Communication SpA 6,750 % éch. 09/02/2027	€	2 000		1 971
Cellnex Finance Co. S.A. 1,500 % éch. 08/06/2028		2 000		1 855
Albion Financing SARL 5,250 % éch. 15/10/2026		1 700		1 678
EP Infrastructure A/S 1,698 % éch. 30/07/2026		1 900		1 441
Logicor Financing SARL 2,250 % éch. 13/05/2025		1 500		1 394
Électricité de France S.A. 2,875 % éch. 15/12/2026		1 800		1 387
Market Bidco Finco PLC 4,750 % éch. 04/11/2027		1 600		1 360
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % éch. 16/02/2026	£	1 400		1 340
Commerzbank AG 4,000 % éch. 05/12/2030	€	1 300		1 229
IHO Verwaltungs GmbH (3,875 % en numéraire ou 4,625 % en PIK) 3,875 % éch. 15/05/2027		1 200		1 222
Adevinta ASA 3,000 % éch. 15/11/2027		1 200		1 195
La Financiere Atalian SASU 5,125 % éch. 15/05/2025		1 300		1 105
Dufry One BV 2,000 % éch. 15/02/2027		1 300		1 103
Gatwick Airport Finance PLC 4,375 % éch. 07/04/2026	£	1 100		1 100
Summer BC Holdco SARL 5,750 % éch. 31/10/2026	€	1 200		1 088
Altice Financing S.A. 3,000 % éch. 15/01/2028		1 200		1 067
Norican A/S 4,500 % éch. 15/05/2023		1 100		1 065
Clarios Global LP 4,375 % éch. 15/05/2026		1 000		990
Zenith Finco PLC 6,500 % éch. 30/06/2027	£	800		951
Elior Group S.A. 3,750 % éch. 15/07/2026	€	1 100		924
FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5,625 % éch. 01/08/2027		900		900
Cellnex Finance Co. S.A. 2,000 % éch. 15/09/2032		1 300		896
Volvo Car AB 4,250 % éch. 31/05/2028		900		894
Nexi SpA 2,125 % éch. 30/04/2029		900		873
InPost S.A. 2,250 % éch. 15/07/2027		900		861
Loarre Investments SARL 6,500 % éch. 15/05/2029		900		850
CTP NV 0,500 % éch. 21/06/2025		1 000		848

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		54 900	€	5 274
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Lorca Telecom Bondco S.A. 4,000 % éch. 18/09/2027	€	2 300		2 082
Deutsche Bank AG 5,625 % éch. 19/05/2031		2 100		2 073
Matterhorn Telecom S.A. 3,125 % éch. 15/09/2026		2 050		1 968
Lincoln Financing SARL 3,625 % éch. 01/04/2024		1 950		1 927
Petroleos Mexicanos 3,625 % éch. 24/11/2025		1 750		1 747
Mauser Packaging Solutions Holding Co. 4,750 % éch. 15/04/2024		1 800		1 723
Albion Financing SARL 6,752 % éch. 17/08/2026		1 700		1 694
Casino Guichard Perrachon S.A. 3,580 % éch. 07/02/2025		1 900		1 625
Dufry One BV 2,500 % éch. 15/10/2024		1 600		1 561
Altice Financing S.A. 2,250 % éch. 15/01/2025		1 500		1 440
Intrum AB 3,500 % éch. 15/07/2026		1 650		1 374
Ford Motor Credit Co. LLC 2,386 % éch. 17/02/2026		1 500		1 355
Q-Park Holding BV 2,000 % éch. 01/03/2027		1 600		1 314
La Financiere Atalian SASU 5,125 % éch. 15/05/2025		1 300		1 254
International Game Technology PLC 2,375 % éch. 15/04/2028		1 400		1 184
eG Global Finance PLC 4,375 % éch. 07/02/2025		1 200		1 170
Ortho-Clinical Diagnostics S.A. 1,000 % éch. 30/06/2025		1 133		1 133
Adevinta ASA 3,000 % éch. 15/11/2027		1 200		1 038
Occidental Petroleum Corp. 6,625 % éch. 01/09/2030	$	1 000		1 031
Banijay Entertainment SASU 3,500 % éch. 01/03/2025	€	1 000		980
CGG S.A. 7,750 % éch. 01/04/2027		1 000		958
Summer (BC) Holdco B SARL 6,611 % éch. 04/12/2026	$	973		940
Renault S.A. 2,375 % éch. 25/05/2026	€	1 000		911
Altice France Holding S.A. 8,000 % éch. 15/05/2027		1 050		910
Axalta Coating Systems Dutch Holding BV 3,750 % éch. 15/01/2025		900		909
IQVIA, Inc. 2,250 % éch. 15/03/2029		900		892
Sigma Bidco BV 3,738 % éch. 02/07/2025		1 000		885
Fenix Marine Service Holdings Ltd. 8,000 % éch. 15/01/2024	$	900		868
Banijay Entertainment SASU 5,375 % éch. 01/03/2025		950		855
Ithaca Energy North Sea PLC 9,000 % éch. 15/07/2026		900		847
Veritas U.S., Inc. 4,750 % éch. 01/09/2025	€	987		844
Bausch Health Americas, Inc. 9,250 % éch. 01/04/2026	$	900		840
Zayo Group Holdings, Inc. 5,148 % éch. 09/03/2027	€	980		804
RCS et RDS S.A. 2,500 % éch. 05/02/2025		900		794
Lagardere S.A. 1,750 % éch. 07/10/2027		800		782

Variations importantes de la composition du portefeuille
Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022 (suite)				
Air France-KLM 1,875 % éch. 16/01/2025	€	800	€	712
Albion Financing SARL 5,250 % éch. 15/10/2026		800		700
IQVIA, Inc. 2,875 % éch. 15/09/2025		700		699
ADLER Group S.A. 1,875 % éch. 14/01/2026		1 100		682

(a) Le Fonds PIMCO European High Yield Bond Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Euro Short-Term Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 27/06/2022	¥	1 830 000	€	13 911
Lloyds Banking Group PLC 1,000 % éch. 15/01/2024	€	9 700		9 656
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,550 % éch. 06/11/2023		9 200		9 131
BNZ International Funding Ltd. 0,625 % éch. 03/07/2025		8 200		8 000
Toronto-Dominion Bank 1,707 % éch. 28/07/2025		6 200		6 217
Virgin Money UK PLC 0,375 % éch. 27/05/2024		6 000		5 919
Wells Fargo & Co. 1,338 % éch. 04/05/2025		6 000		5 895
Morgan Stanley 0,637 % éch. 26/07/2024		5 900		5 828
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 2,264 % éch. 14/06/2025		5 800		5 791
Korea Housing Finance Corp. 0,723 % éch. 22/03/2025		5 700		5 700
Bank of Ireland Group PLC 1,375 % éch. 29/08/2023		5 600		5 585
Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 03/08/2022	ILS	20 000		5 576
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 14/11/2022	¥	700 000		5 112
Wells Fargo & Co. 0,500 % éch. 26/04/2024	€	5 200		5 047
Credit Suisse AG 3,184 % éch. 31/05/2024		4 900		4 905
LT Autorahoitus DAC 1,000 % éch. 17/12/2032		4 500		4 500
Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. 3,508 % éch. 26/01/2025	£	3 700		4 401
HSBC Holdings PLC 0,875 % éch. 06/09/2024	€	4 200		4 284
HSBC Holdings PLC 1,500 % éch. 04/12/2024		4 200		4 154
Goldman Sachs Group, Inc. 2,732 % éch. 07/02/2025		4 000		4 036

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
Goldman Sachs Group, Inc. 2,605 % éch. 30/04/2024	€	12 200	€	12 248
Nykredit Realkredit A/S 2,000 % éch. 01/10/2050	DKK	100 300		12 122
Santander UK Group Holdings PLC 2,975 % éch. 27/03/2024	€	10 500		10 568
Lloyds Banking Group PLC 1,000 % éch. 15/01/2024		9 700		9 649
Laurelin DAC 2,176 % éch. 20/10/2031		8 000		7 742
Blackrock European CLO DAC 1,998 % éch. 15/10/2031		7 800		7 555
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 0,000 % éch. 03/03/2024		7 800		7 492
Obligation internationale du gouvernement israélien 0,000 % éch. 22/07/2022		7 100		7 101
Bureau Veritas S.A. 1,250 % éch. 07/09/2023		6 900		6 784
First Abu Dhabi Bank PJSC 1,189 % éch. 16/04/2022	$	7 400		6 585
MPT Operating Partnership LP 2,550 % éch. 05/12/2023	£	5 800		6 584
Virgin Money UK PLC 2,875 % éch. 24/06/2025	€	6 500		6 506
Obligation internationale du gouvernement indonésien 2,625 % éch. 14/06/2023		5 800		5 860
DBS Bank Ltd. 2,087 % éch. 17/11/2025	£	4 700		5 780
Ares European CLO DAC 2,038 % éch. 15/10/2030	€	5 690		5 533
Primrose Residential DAC 2,644 % éch. 24/03/2061		5 627		5 501
General Motors Financial Co., Inc. 0,000 % éch. 26/03/2022		5 300		5 304
Wells Fargo & Co. 0,500 % éch. 26/04/2024		5 200		4 994
BAT International Finance PLC 7,250 % éch. 12/03/2024	£	3 800		4 821
Nissan Motor Co. Ltd. 1,940 % éch. 15/09/2023	€	4 800		4 806

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		292 400	€	28 181
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 24/10/2022	¥	720 000		5 175
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 14/11/2022		680 000		4 966
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2031	€	3 339		3 908
Obligation internationale du gouvernement espagnol 2,550 % éch. 31/10/2032		3 000		3 000
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/10/2027 (b)	$	2 907		2 806
Nykredit Realkredit A/S 3,500 % éch. 01/10/2053	DKK	19 700		2 573
DVI Deutsche Vermoegens- & Immobilienverwaltungs GmbH 2,500 % éch. 25/01/2027	€	1 900		1 890
Realkredit Danmark A/S 3,000 % éch. 01/10/2053	DKK	13 900		1 800
Nykredit Realkredit A/S 5,000 % éch. 01/10/2053		13 900		1 798
Primrose Residential DAC 2,644 % éch. 24/03/2061	€	1 505		1 462
Ripon Mortgages PLC 4,011 % éch. 28/08/2056	£	1 200		1 428
Palmer Square European Loan Funding DAC 2,428 % éch. 15/10/2031	€	1 300		1 300
Obligation internationale du gouvernement slovène 1,175 % éch. 13/02/2062		1 300		1 297
Credit Suisse Schweiz AG 3,390 % éch. 05/12/2025		1 200		1 200
Silfin NV 2,875 % éch. 11/04/2027		1 200		1 189
Électricité de France S.A. 2,625 % éch. 01/12/2027		1 200		1 142
Goldman Sachs Group, Inc. 2,732 % éch. 07/02/2025		1 100		1 110
Obligation internationale du gouvernement slovène 1,750 % éch. 03/11/2040		1 100		1 107
Palmer Square European Loan Funding DAC 2,098 % éch. 15/10/2031		1 100		1 100

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF (a)		363 400	€	34 904
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			
Jyske Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	123 600		13 998
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050		109 500		11 184
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050		88 976		9 475
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2053		68 800		6 900
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2030 (b)	$	6 949		6 579
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2053	DKK	61 775		6 571
Obligation internationale du gouvernement espagnol 1,250 % éch. 31/10/2030	€	5 800		5 193
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2031		3 259		3 856
Bayer Capital Corp. BV 0,067 % éch. 27/06/2022		3 800		3 806
Coventry Building Society 1,500 % éch. 23/01/2023	£	3 100		3 648
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	30 030		3 396
Jyske Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050		29 288		3 057
Société Générale S.A. 0,277 % éch. 01/04/2022	€	2 900		2 905
Obligation internationale du gouvernement espagnol 2,550 % éch. 31/10/2032		3 000		2 847
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2031 (b)	$	2 835		2 716
Jyske Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2053	DKK	21 073		2 147
Obligation internationale du gouvernement espagnol 0,100 % éch. 30/04/2031	€	2 600		2 133
Barclays Bank PLC 7,625 % éch. 21/11/2022	$	2 100		2 080
Union européenne 0,000 % éch. 04/07/2031	€	2 100		2 015

(a) Le Fonds PIMCO European Short-Term Opportunities Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Global Advantage Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		14 435 416	$	143 647
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligation internationale du gouvernement singapourien 1,625 % éch. 01/07/2031	SGD	9 000		6 360
Ripon Mortgages PLC 4,011 % éch. 28/08/2056	£	3 900		5 324
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 24/10/2022	¥	710 000		5 221
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 20/03/2027		490 000		3 812
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2032 (b)	$	3 773		3 563
Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 08/02/2023	ILS	9 900		2 948
Obligation du gouvernement chinois 2,680 % éch. 21/05/2030	CNY	18 200		2 819
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,480 % éch. 15/03/2023	MYR	13 000		2 760
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 5,500 % éch. 22/02/2029	$	2 600		2 600
Obligation internationale du gouvernement singapourien 2,875 % éch. 01/09/2030	SGD	3 200		2 504
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 1,585 % éch. 17/12/2035	THB	94 700		2 076
Credit Suisse Group AG 7,750 % éch. 01/03/2029	€	1 700		1 794
Obligation du gouvernement chinois 3,810 % éch. 14/09/2050	CNY	10 600		1 790
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2031	€	1 669		1 721
Obligation internationale du gouvernement israélien 1,500 % éch. 30/11/2023	ILS	6 000		1 718
Prosus NV 1,207 % éch. 19/01/2026	€	1 500		1 713
ING Groep NV 1,750 % éch. 16/02/2031		1 500		1 705
Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 31/07/2051	£	1 700		1 607
Prosus NV 3,257 % éch. 19/01/2027	$	1 600		1 600

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		14 460 126	$	143 900
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligation du gouvernement chinois 3,280 % éch. 03/12/2027	CNY	64 900		10 586
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 20/09/2031	¥	1 280 000		9 934
Obligation du gouvernement chinois 3,020 % éch. 22/10/2025	CNY	55 700		8 930
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 20/06/2031	¥	850 000		6 475
Obligation internationale du gouvernement singapourien 1,625 % éch. 01/07/2031	SGD	9 000		5 841
New South Wales Treasury Corp. 2,750 % éch. 20/11/2025	AUD	5 200		5 322
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 24/10/2022	¥	710 000		4 905
Obligation internationale du gouvernement du Koweït 3,500 % éch. 20/03/2027	$	3 800		4 044
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 20/03/2027	¥	490 000		3 617
Obligation internationale du gouvernement singapourien 2,875 % éch. 01/09/2030	SGD	5 000		3 611
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	34 000		3 578
Billets du Trésor américain 2,875 % éch. 30/04/2025	$	3 400		3 413
China Development Bank 3,340 % éch. 14/07/2025	CNY	19 800		3 168
Obligation internationale du gouvernement d'Arabie saoudite 4,375 % éch. 16/04/2029	$	2 800		3 050
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,733 % éch. 15/06/2028	MYR	12 200		2 898
Obligation du gouvernement chinois 2,680 % éch. 21/05/2030	CNY	18 200		2 819
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 5,500 % éch. 22/02/2029	$	2 600		2 438
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 1,585 % éch. 17/12/2035	THB	94 700		2 236
China Development Bank 4,040 % éch. 10/04/2027	CNY	13 200		2 180

(a) Le Fonds Global Advantage Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Global Bond Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		99 261 574	$	987 929
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 20/06/2027	¥	48 796 000		354 221
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 20/03/2027		34 700 000		269 917
Obligation internationale du gouvernement singapourien 1,625 % éch. 01/07/2031	SGD	265 448		187 202
Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 08/02/2023	ILS	616 388		181 055
Ripon Mortgages PLC 4,011 % éch. 28/08/2056	£	105 800		144 417
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 11/01/2023	¥	15 000 000		103 699
Obligation internationale du gouvernement singapourien 2,875 % éch. 01/09/2030	SGD	84 850		66 337
		ACTIONS		
PIMCO Global Investors Series PLC - Fonds Emerging Markets Opportunities Fund (a)		6 694 130		65 000
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 1,585 % éch. 17/12/2035	THB	2 670 500		59 446
Obligation du gouvernement chinois 3,810 % éch. 14/09/2050	CNY	324 100		54 596
Obligation internationale du gouvernement australien 4,500 % éch. 21/04/2033	AUD	63 300		47 169
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,480 % éch. 15/03/2023	MYR	200 400		42 568
Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2052	$	38 080		41 317
Freddie Mac 2,500 % éch. 01/01/2052		44 681		40 689
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,900 % éch. 30/11/2026	MYR	155 600		37 955
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 24/10/2022	¥	4 950 000		36 399
Obligation internationale du gouvernement malaisien 4,065 % éch. 15/06/2050	MYR	156 400		34 270
Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042	$	35 500		34 178
JPMorgan Chase & Co. 4,080 % éch. 26/04/2026		33 800		33 800

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		92 939 176	$	925 000
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 20/06/2031	¥	54 860 000		412 252
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 20/06/2027		48 796 000		355 245
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 20/03/2027		34 700 000		257 441
China Development Bank 3,680 % éch. 26/02/2026	CNY	1 542 800		252 670
China Development Bank 4,040 % éch. 10/04/2027		1 133 400		187 159
Obligation internationale du gouvernement singapourien 1,625 % éch. 01/07/2031	SGD	265 448		172 099
Obligation internationale du gouvernement japonais 1,400 % éch. 20/09/2034	¥	14 880 000		125 153
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 20/09/2031		15 395 550		118 591
Obligation internationale du gouvernement espagnol 1,400 % éch. 30/07/2028	€	98 150		111 732
China Development Bank 4,240 % éch. 24/08/2027	CNY	663 600		110 814
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	1 025 310		105 041
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,850 % éch. 01/07/2025	€	100 000		100 779
China Development Bank 3,050 % éch. 25/08/2026	CNY	635 000		100 417
Obligation internationale du gouvernement australien 0,500 % éch. 21/09/2026	AUD	143 300		99 909
China Development Bank 4,880 % éch. 09/02/2028	CNY	573 400		91 035
Obligation internationale du gouvernement singapourien 2,875 % éch. 01/09/2030	SGD	119 970		86 747
		ACTIONS		
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		826 600		81 542
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Émission d'investissement du gouvernement malaisien 4,369 % éch. 31/10/2028	MYR	330 020		74 129
Obligation internationale du gouvernement espagnol 0,850 % éch. 30/07/2037	€	67 450		66 141

(a) Le Fonds Global Bond Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Global Bond ESG Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 31/10/2022	¥	13 700 000	$	102 543
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 20/06/2027		11 281 000		81 886
République d'Allemagne 0,000 % éch. 15/08/2031	€	53 800		61 360
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 20/03/2027	¥	7 460 000		58 028
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % éch. 01/12/2051	$	45 582		45 511
Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 08/02/2023	ILS	138 614		39 936
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 14/11/2022	¥	4 890 000		36 583
Obligation internationale du gouvernement singapourien 1,625 % éch. 01/07/2031	SGD	45 700		32 228
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 05/09/2022	¥	3 390 000		25 938
Deutsche Bank AG 3,961 % éch. 26/11/2025	$	27 600		25 511
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2032 (a)		26 742		24 830
Ripon Mortgages PLC 4,011 % éch. 28/08/2056	£	18 100		24 707
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 27/06/2022	¥	2 850 000		24 068
Obligation du gouvernement chinois 2,680 % éch. 21/05/2030	CNY	151 100		23 403
Federal Home Loan Bank 4,320 % éch. 06/01/2023	$	22 700		22 700
Morgan Stanley 3,622 % éch. 01/04/2031		23 800		20 344
Deutsche Bank AG 1,875 % éch. 23/02/2028	€	16 400		18 570
Obligation internationale du gouvernement israélien 1,500 % éch. 30/11/2023	ILS	64 100		18 350
Obligation internationale du gouvernement singapourien 2,875 % éch. 01/09/2030	SGD	19 600		15 323
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2031 (a)	$	16 281		14 605

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 20/06/2027	¥	11 281 000	$	82 691
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 20/06/2031		10 180 000		75 197
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 20/03/2027		7 460 000		55 316
Obligation du gouvernement chinois 3,020 % éch. 22/10/2025	CNY	187 300		30 011
Obligation internationale du gouvernement singapourien 1,625 % éch. 01/07/2031	SGD	45 700		29 625
China Development Bank 4,240 % éch. 24/08/2027	CNY	159 800		26 796
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 20/09/2031	¥	3 350 000		25 891
Obligation du gouvernement chinois 2,680 % éch. 21/05/2030	CNY	151 100		22 449
Obligation internationale du gouvernement singapourien 2,875 % éch. 01/09/2030	SGD	25 500		18 424
Obligation du gouvernement chinois 3,280 % éch. 03/12/2027	CNY	93 900		15 356
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,700 % éch. 20/06/2051	¥	1 830 000		13 283
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 1,585 % éch. 17/12/2035	THB	528 100		12 474
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	119 900		12 471
Émission d'investissement du gouvernement malaisien 4,369 % éch. 31/10/2028	MYR	49 500		11 306
China Development Bank 3,680 % éch. 26/02/2026	CNY	67 600		11 070
Obligation du gouvernement chinois 3,720 % éch. 12/04/2051		66 700		10 124
Obligation du gouvernement chinois 3,010 % éch. 13/05/2028		62 300		9 927
Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042	$	9 000		8 623
BPCE S.A. 2,045 % éch. 19/10/2027		9 600		8 610
Bon du Trésor britannique 0,875 % éch. 31/07/2033	£	9 000		8 310

(a) Le montant principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille
Fonds Global Bond Ex-US Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		64 432 338	$	641 210
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 20/06/2027	¥	4 698 000		33 930
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 20/03/2027		2 690 000		20 923
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 24/10/2022		1 620 000		11 913
Obligation internationale du gouvernement singapourien 1,625 % éch. 01/07/2031	SGD	16 400		11 566
China Development Bank 4,040 % éch. 10/04/2027	CNY	60 800		10 159
Ripon Mortgages PLC 4,011 % éch. 28/08/2056	£	7 300		9 965
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 20/09/2031	¥	680 000		5 860
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,700 % éch. 20/09/2051		720 000		5 783
Obligation du gouvernement chinois 3,010 % éch. 13/05/2028	CNY	35 900		5 760
Obligation internationale du gouvernement français 2,250 % éch. 25/10/2022	€	5 300		5 617
Obligation du gouvernement chinois 3,810 % éch. 14/09/2050	CNY	32 800		5 527
Obligation internationale du gouvernement singapourien 2,875 % éch. 01/09/2030	SGD	6 500		5 058
Obligation internationale du gouvernement malaisien 3,480 % éch. 15/03/2023	MYR	22 800		4 841
Obligation du gouvernement chinois 3,530 % éch. 18/10/2051	CNY	29 100		4 754
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 1,585 % éch. 17/12/2035	THB	199 700		4 510
Obligation internationale du gouvernement thaïlandais 2,000 % éch. 17/12/2031		142 600		4 256
Obligation du gouvernement chinois 2,680 % éch. 21/05/2030	CNY	26 100		4 042
Genesis Mortgage Funding PLC 4,603 % éch. 15/09/2059	£	3 100		3 876
Obligation du gouvernement chinois 2,370 % éch. 20/01/2027	CNY	25 000		3 653

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		60 283 081	$	599 900
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 20/06/2031	¥	6 180 000		45 765
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 20/06/2027		4 698 000		34 377
Obligation internationale du gouvernement japonais 1,400 % éch. 20/09/2034		3 220 000		25 342
China Development Bank 4,040 % éch. 10/04/2027	CNY	152 020		24 931
China Development Bank 4,240 % éch. 24/08/2027		152 200		22 501
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,005 % éch. 20/03/2027	¥	2 690 000		19 958
China Development Bank 3,680 % éch. 26/02/2026	CNY	113 900		18 604
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,450 % éch. 15/11/2024	€	13 100		13 226
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 20/09/2031	¥	1 650 000		12 799
Obligation du gouvernement chinois 3,030 % éch. 11/03/2026	CNY	74 700		11 993
Obligation internationale du gouvernement singapourien 1,625 % éch. 01/07/2031	SGD	16 400		10 633
Obligation internationale du gouvernement espagnol 1,400 % éch. 30/07/2028	€	9 200		10 473
Obligation du gouvernement chinois 3,280 % éch. 03/12/2027	CNY	59 100		9 657
Obligation internationale du gouvernement australien 0,500 % éch. 21/09/2026	AUD	10 400		7 249
Obligation internationale du gouvernement singapourien 2,875 % éch. 01/09/2030	SGD	9 300		6 712
China Development Bank 4,880 % éch. 09/02/2028	CNY	40 800		6 226
China Development Bank 3,500 % éch. 13/08/2026		38 000		6 118
Émission d'investissement du gouvernement malaisien 4,369 % éch. 31/10/2028	MYR	27 000		6 001
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,850 % éch. 01/07/2025	€	5 600		5 637

(a) Le Fonds Global Bond Ex-US Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		68 430 245	$	680 984
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 11/01/2023	¥	8 378 000		57 920
Colombian TES 6,250 % éch. 26/11/2025	COP	85 411 000		18 552
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	239 700		15 413
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026		220 300		14 522
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,700 % éch. 01/09/2030	CLP	10 780 000		12 037
Colombian TES 7,750 % éch. 18/09/2030	COP	39 400 000		9 540
Obligation internationale du gouvernement japonais 1,700 % éch. 20/09/2044	¥	600 000		5 185
		ACTIONS		
Activision Blizzard, Inc.		63 273		5 135
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligation internationale du gouvernement espagnol 0,700 % éch. 30/04/2032	€	5 000		4 241
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 8,000 % éch. 31/01/2030	ZAR	66 800		4 131
		ACTIONS		
Airbus SE		35 755		4 071
Renewable Energy Group, Inc.		63 204		3 859
First Horizon Corp.		161 653		3 847
LHC Group, Inc.		22 910		3 837
TEGNA, Inc.		168 148		3 831
Alleghany Corp.		4 414		3 698
Twitter, Inc.		70 963		3 561
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.		5 035		3 464
Vertex Pharmaceuticals, Inc.		12 713		3 316

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		67 799 972	$	674 753
PIMCO Funds: Global Investors Series plc - Fonds Mortgage Opportunities Fund (a)		12 863 704		131 853
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Colombian TES 6,250 % éch. 26/11/2025	COP	156 861 000		32 417
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 20/09/2031	¥	4 000 000		29 942
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	312 400		20 186
Obligation du gouvernement chinois 3,280 % éch. 03/12/2027	CNY	121 340		19 113
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	180 550		13 289
		ACTIONS		
Apple, Inc.		66 100		10 735
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	42 959		5 777
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos 4,700 % éch. 01/09/2030	CLP	5 580 000		5 311
Obligation du gouvernement chinois 2,850 % éch. 04/06/2027	CNY	31 300		4 677
		ACTIONS		
Activision Blizzard, Inc.		58 575		4 354
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Jyske Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	31 892		4 294
		ACTIONS		
Airbus SE		35 755		3 759
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 8,000 % éch. 31/01/2030	ZAR	66 800		3 627
Obligation internationale du gouvernement péruvien 5,940 % éch. 12/02/2029	PEN	13 700		3 602
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	25 419		3 423
Globalworth Real Estate Investments Ltd. 3,000 % éch. 29/03/2025	€	3 200		3 375
Obligation internationale du gouvernement péruvien 8,200 % éch. 12/08/2026	PEN	9 100		2 673
Obligation internationale du gouvernement péruvien 5,400 % éch. 12/08/2034		13 200		2 666

(a) Le Fonds PIMCO Global Core Asset Allocation Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille
Fonds Global High Yield Bond Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		72 395 209	$	720 543
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/11/2027	$	90 700		90 948
Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 31/10/2027		78 000		77 878
Billets du Trésor américain 4,250 % éch. 15/10/2025		58 000		57 480
Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 15/09/2025		40 000		39 259
Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 30/09/2027		20 000		19 798
Ctec GmbH 5,250 % éch. 15/02/2030	€	12 000		13 406
Royal Caribbean Cruises Ltd. 5,500 % éch. 31/08/2026	$	10 000		8 604
WP/AP Telecom Holdings BV 3,750 % éch. 15/01/2029	€	7 300		6 737
Inter Media and Communication SpA 6,750 % éch. 09/02/2027		6 000		6 689
FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA 5,625 % éch. 01/08/2027		5 800		6 622
IMA Industria Macchine Automatiche SpA 3,750 % éch. 15/01/2028		7 000		6 301
Cloud Software Group Holdings, Inc. 6,500 % éch. 31/03/2029	$	7 000		5 935
ZF Europe Finance BV 3,000 % éch. 23/10/2029	€	5 600		5 365
Trivium Packaging Finance BV 3,750 % éch. 15/08/2026		5 000		5 007
Tenet Healthcare Corp. 6,125 % éch. 15/06/2030	$	5 000		5 000
Community Health Systems, Inc. 5,250 % éch. 15/05/2030		5 000		5 000
Spirit Loyalty Cayman Ltd. 8,000 % éch. 20/09/2025		5 000		4 984
International Game Technology PLC 2,375 % éch. 15/04/2028	€	5 500		4 954
ZF Finance GmbH 2,250 % éch. 03/05/2028		5 000		4 952

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		93 243 437	$	928 065
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Sotera Health Holdings LLC 7,165 % éch. 11/12/2026	$	25 000		24 725
Kraft Heinz Foods Co. 5,200 % éch. 15/07/2045		18 250		19 775
Bellis Acquisition Co. PLC 3,250 % éch. 16/02/2026	£	12 375		12 261
Sprint Corp. 7,125 % éch. 15/06/2024	$	10 000		10 775
Telecom Italia SpA 5,303 % éch. 30/05/2024		10 500		10 471
Ford Motor Credit Co. LLC 2,684 % éch. 01/12/2024	€	9 250		9 620
Ardagh Packaging Finance PLC 4,125 % éch. 15/08/2026	$	10 000		8 955
Freeport-McMoRan, Inc. 5,400 % éch. 14/11/2034		7 625		8 741
Sigma Holdco BV 5,750 % éch. 15/05/2026	€	11 000		8 527
WESCO Distribution, Inc. 7,125 % éch. 15/06/2025	$	8 000		8 304
		ACTIONS		
Noble Corp.		231 945		7 328
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Targa Resources Partners LP 5,500 % éch. 01/03/2030	$	7 000		7 287
MEG Energy Corp. 7,125 % éch. 01/02/2027		7 000		7 139
Lloyds Banking Group PLC 7,625 % éch. 27/06/2023	£	5 000		6 856
T-Mobile USA, Inc. 2,875 % éch. 15/02/2031	$	7 750		6 811
Targa Resources Partners LP 5,000 % éch. 15/01/2028		6 500		6 652
Occidental Petroleum Corp. 6,600 % éch. 15/03/2046		6 000		6 422
IRB Holding Corp. 7,000 % éch. 15/06/2025		6 000		6 248
T-Mobile USA, Inc. 2,625 % éch. 15/02/2029		7 000		6 230

(a) Le Fonds Global High Yield Bond Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Global Investment Grade Credit Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		374 868 009	$	3 730 320
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/11/2051	$	289 842		267 938
Billets du Trésor américain 1,875 % éch. 15/02/2032		259 218		248 932
Billets du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2032		236 574		235 804
Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/09/2029		206 000		205 712
Obligations du Trésor américain 2,000 % éch. 15/11/2041		191 400		187 451
Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042		141 316		142 452
Obligations du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2052		137 600		131 597
Obligations du Trésor américain 2,250 % éch. 15/02/2052		70 400		58 995
Obligations du Trésor américain 2,375 % éch. 15/02/2042		53 700		48 980
Obligation internationale du gouvernement australien 4,500 % éch. 21/04/2033	AUD	59 700		44 373
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	455 600		33 323
Bank of America Corp. 2,551 % éch. 04/02/2028	$	26 100		26 100
Obligations du Trésor américain 3,125 % éch. 15/08/2044		25 700		22 010
Société Générale S.A. 2,889 % éch. 09/06/2032		25 000		20 396
Holding d'Infrastructures de Transport SASU 1,475 % éch. 18/01/2031	€	16 200		18 197
Goldman Sachs Group, Inc. 4,482 % éch. 23/08/2028	$	17 300		17 300
Wells Fargo & Co. 4,897 % éch. 25/07/2033		15 000		15 198
BNP Paribas S.A. 5,198 % éch. 10/01/2030		15 000		15 160
Oracle Corp. 6,250 % éch. 09/11/2032		14 500		14 474

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		377 896 499	$	3 760 800
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Billets du Trésor américain 1,875 % éch. 15/02/2032	$	259 218		236 426
Billets du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2032		236 574		232 005
Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/11/2051		125 471		119 434
Las Vegas Sands Corp. 3,200 % éch. 08/08/2024		70 200		66 720
Obligations du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2049		59 006		64 047
Boeing Co. 5,150 % éch. 01/05/2030		65 394		62 833
Obligations du Trésor américain 1,625 % éch. 15/11/2050		60 000		47 991
Billets du Trésor américain 3,375 % éch. 15/11/2048		40 118		47 124
Wells Fargo & Co. 1,741 % éch. 04/05/2030	€	37 400		40 531
Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/02/2041	$	42 300		36 845
Goldman Sachs Group, Inc. 0,000 % éch. 05/06/2023		34 000		34 084
Amber Circle Funding Ltd. 3,250 % éch. 04/12/2022		33 625		33 599
Foxconn Far East Ltd. 1,625 % éch. 28/10/2025		34 200		32 602
Vanke Real Estate Hong Kong Co. Ltd. 4,150 % éch. 18/04/2023		31 600		31 610
Obligations du Trésor américain 3,000 % éch. 15/02/2048		28 400		30 678
Wynn Macau Ltd. 5,500 % éch. 01/10/2027		37 265		30 463
Cornerstone Building Brands, Inc. 7,568 % éch. 12/04/2028		33 264		28 301
CaixaBank S.A. 5,875 % éch. 09/10/2027	€	31 000		27 985
United Airlines Pass-Through Trust 5,875 % éch. 15/04/2029	$	27 226		27 601

(a) Le Fonds Global Investment Grade Credit Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022			
Obligations du Trésor américain 2,375 % éch. 15/02/2042	$	57 200	$ 54 814
Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042		45 000	44 484
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (a)		30 774	29 191
Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042		23 300	23 491
Billets du Trésor américain 4,250 % éch. 15/10/2025		21 700	21 515
Obligations du Trésor américain 2,000 % éch. 15/11/2041		19 600	19 127
République d'Allemagne 0,000 % éch. 15/08/2031	€	14 700	15 455
Bank of America Corp. 3,384 % éch. 02/04/2026	$	11 900	11 896
Obligations du Trésor américain 3,375 % éch. 15/08/2042		12 300	11 799
Union européenne 2,750 % éch. 04/12/2037	€	10 000	10 482
Obligation internationale du gouvernement canadien 2,250 % éch. 01/12/2029	CAD	12 200	9 637
GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC 3,375 % éch. 24/03/2029	$	9 050	8 954
Union européenne 1,250 % éch. 04/02/2043	€	8 000	8 556
Corebridge Financial, Inc. 3,900 % éch. 05/04/2032	$	8 200	8 166
Wells Fargo & Co. 4,540 % éch. 15/08/2026		7 800	7 800
Zoetis, Inc. 2,000 % éch. 15/05/2030		8 500	7 648
Mizuho Financial Group, Inc. 2,839 % éch. 13/09/2026		8 261	7 558
S&P Global, Inc. 2,700 % éch. 01/03/2029		7 500	7 444
Welltower, Inc. 3,850 % éch. 15/06/2032		7 400	7 396
Communauté autonome de Madrid 1,723 % éch. 30/04/2032	€	6 000	6 699

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022			
Amgen, Inc. 3,000 % éch. 22/02/2029	$	6 600	$ 6 059
Illumina, Inc. 2,550 % éch. 23/03/2031		7 650	5 982
Baxter International, Inc. 2,272 % éch. 01/12/2028		7 000	5 777
Equinix, Inc. 1,550 % éch. 15/03/2028		6 700	5 623
Communauté autonome de Madrid 1,723 % éch. 30/04/2032	€	6 000	5 598
BNP Paribas S.A. 1,675 % éch. 30/06/2027	$	6 000	5 246
Banco do Brasil S.A. 4,875 % éch. 11/01/2029		5 000	4 865
Crown Castle International Corp. 4,300 % éch. 15/02/2029		4 800	4 620
Union Electric Co. 3,900 % éch. 01/04/2052		5 700	4 403
Nucor Corp. 3,950 % éch. 23/05/2025		4 400	4 370
Georgia Power Co. 3,250 % éch. 15/03/2051		5 730	4 232
LeasePlan Corp. NV 0,750 % éch. 03/10/2022	€	4 100	4 221
Equinix, Inc. 3,900 % éch. 15/04/2032	$	4 500	4 163
Bank of America Corp. 3,384 % éch. 02/04/2026		4 100	3 920
Welltower, Inc. 3,850 % éch. 15/06/2032		4 500	3 902
Morgan Stanley 4,210 % éch. 20/04/2028		4 000	3 898
Vmed O2 UK Financing PLC 4,750 % éch. 15/07/2031		4 900	3 834
Woolworths Group Ltd. 0,375 % éch. 15/11/2028	€	4 800	3 796
Ford Motor Co. 6,100 % éch. 19/08/2032	$	4 074	3 764
PacifiCorp 2,900 % éch. 15/06/2052		5 100	3 706

(a) Le montant principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Global Low Duration Real Return Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		22 764 320	$ 226 560
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2026 (b)	$	72 582	71 948
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/01/2028 (b)		71 161	70 182
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/01/2027 (b)		60 029	57 494
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/01/2025 (b)		50 871	50 019
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2025 (b)		47 246	46 626
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2027 (b)		39 855	40 094
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2027 (b)		41 216	39 819
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2026 (b)		37 509	39 698
Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 22/11/2027	£	28 850	37 973
Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 22/03/2024		27 117	35 658
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2025 (b)	$	33 585	33 817
République d'Allemagne 0,500 % éch. 15/04/2030	€	24 119	26 174
Bon du Trésor britannique 0,625 % éch. 07/06/2025	£	23 000	24 814
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 10/03/2029	¥	2 633 176	20 010
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/10/2027 (b)	$	19 436	19 618
République d'Allemagne 0,100 % éch. 15/04/2026	€	17 938	19 042
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b)	$	19 077	18 665
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2024 (b)		18 337	18 408
République d'Allemagne 0,100 % éch. 15/04/2023	€	15 366	17 897
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/04/2024 (b)	$	14 093	13 815
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/04/2023 (b)		13 516	13 726
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2026 (b)		12 914	12 253

DESCRIPTION		ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		22 757 745	$ 226 500
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2023 (b)	$	85 413	88 401
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/04/2023 (b)		72 960	73 636
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2031 (b)		50 303	52 878
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2026 (b)		33 151	32 690
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2022 (b)		29 519	29 799
Bon du Trésor britannique 2,500 % éch. 17/07/2024	£	5 330	26 551
Bon du Trésor britannique 0,625 % éch. 07/06/2025		23 000	24 918
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2030 (b)	$	21 410	21 103
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 10/03/2029	¥	2 410 825	19 848
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	156 847	18 724
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2027 (b)	$	18 879	18 339
Obligation internationale du gouvernement français 1,100 % éch. 25/07/2022	€	15 621	17 937
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % éch. 15/05/2030		14 860	16 922
Obligation internationale du gouvernement français 0,250 % éch. 25/07/2024		11 176	13 595
Bon du Trésor britannique 1,875 % éch. 22/11/2022	£	8 496	11 905
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	95 496	11 484
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 01/03/2029	€	8 887	10 947
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2022 (b)	$	7 947	8 105
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2025 (b)		7 771	8 049

(a) Le Fonds Global Low Duration Real Return Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Global Real Return Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		82 239 295	$ 818 334
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		**COÛT (en milliers)**
Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 22/11/2027	£	62 876	97 572
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/01/2028 (b)	$	92 730	87 822
Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 10/08/2031	£	46 677	81 837
Bon du Trésor britannique 1,000 % éch. 22/04/2024		71 300	77 919
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/10/2027 (b)	$	64 795	65 341
Bon du Trésor britannique 0,750 % éch. 22/03/2034	£	36 701	65 288
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % éch. 15/05/2033	€	53 703	62 306
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2032 (b)	$	52 620	55 455
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2025 (b)		42 994	42 671
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2031	€	29 839	37 828
Obligation internationale du gouvernement français 0,500 % éch. 25/05/2029		37 500	36 298
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/04/2023 (b)	$	32 637	33 892
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2023 (b)		30 621	31 542
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,350 % éch. 01/04/2030	€	33 900	30 488
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2027 (b)	$	26 914	27 703
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 10/03/2029	¥	3 246 046	24 314
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2025 (b)	$	23 423	23 877
Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 22/03/2068	£	12 200	23 273
Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 10/08/2041		22 496	20 077

DESCRIPTION		ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		81 551 060	$ 811 500
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		**PRODUIT (en milliers)**
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % éch. 15/05/2030	€	130 161	146 092
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2022 (b)	$	143 743	144 466
Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 22/11/2027	£	72 678	118 474
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2031 (b)	$	107 962	112 982
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2023 (b)		83 793	83 931
Bon du Trésor britannique 1,000 % éch. 22/04/2024	£	71 300	78 111
Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 22/11/2032		44 759	71 651
Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 10/08/2031		50 673	66 942
Obligation internationale du gouvernement français 0,250 % éch. 25/07/2024	€	50 229	59 104
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 01/03/2029		51 980	57 230
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2031 (b)	$	52 729	57 107
Obligation internationale du gouvernement français 0,700 % éch. 25/07/2030	€	43 364	53 525
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % éch. 15/05/2033		56 182	50 300
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2031		42 407	46 184
Realkredit Danmark A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	303 000	38 198
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 10/03/2028	¥	4 536 453	36 947
Obligation internationale du gouvernement français 0,500 % éch. 25/05/2029	€	37 500	36 502
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % éch. 01/10/2050	DKK	294 532	35 428
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,350 % éch. 01/04/2030	€	33 900	30 409
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 10/03/2029	¥	3 338 216	29 264

(a) Le Fonds Global Real Return Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille Fonds Income Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	113 834 811	$ 1 132 782

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)
Ripon Mortgages PLC 4,011 % éch. 28/08/2056	£ 610 000	832 651
Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/09/2029	$ 819 800	818 655
Billets du Trésor américain 2,750 % éch. 15/08/2032	832 400	752 898
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b)	698 578	685 318
Billets du Trésor américain 4,000 % éch. 31/10/2029	592 900	591 932
Fannie Mae 3,000 % éch. 01/06/2052	683 955	587 591
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2024 (b)	560 307	545 565
Obligations du Trésor américain 1,375 % éch. 15/08/2050	830 000	539 500
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2023 (b)	533 195	528 822
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/04/2024 (b)	512 645	500 687
Freddie Mac 3,000 % éch. 01/07/2052	560 510	498 500
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b)	495 993	467 240
Fannie Mae 3,500 % éch. 01/05/2052	510 123	464 969
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b)	376 263	364 402
Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % éch. 25/01/2030	337 627	329 186
Freddie Mac 3,500 % éch. 01/07/2052	334 012	325 027
Freddie Mac 3,000 % éch. 01/06/2052	344 996	319 504
Obligations du Trésor américain 1,250 % éch. 15/05/2050	500 000	314 063
Billets du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2032	248 790	248 739
Fannie Mae 4,000 % éch. 01/08/2051	226 482	239 646
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % éch. 01/08/2052	279 250	237 340
Billets du Trésor américain 2,375 % éch. 31/03/2029	224 600	222 822
Obligations du Trésor américain 2,250 % éch. 15/02/2052	260 620	211 794
Carvana Co. 10,250 % éch. 01/05/2030	204 910	203 253
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 01/03/2023	¥ 27 972 000	201 670
Fannie Mae 4,000 % éch. 01/10/2051	$ 177 478	187 794

DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	186 497 216	$ 1 856 000

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/09/2029	$ 819 800	811 244
Obligations du Trésor américain 1,375 % éch. 15/08/2050	1 080 000	750 416
Billets du Trésor américain 1,125 % éch. 15/02/2031	439 881	382 940
Billets du Trésor américain 2,625 % éch. 31/01/2026	381 000	378 655
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % éch. 01/03/2049	321 901	326 629
Obligations du Trésor américain 1,250 % éch. 15/05/2050	500 000	320 000
Freddie Mac 3,500 % éch. 01/07/2052	278 339	269 293
China Development Bank 3,740 % éch. 10/09/2025	CNY 1 530 900	249 049
Obligations du Trésor américain 2,250 % éch. 15/08/2046	$ 250 000	243 906
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/07/2029 (b)	212 266	221 351
Fannie Mae 4,000 % éch. 01/08/2051	213 588	220 212
Obligations du Trésor américain 2,250 % éch. 15/02/2052	260 620	215 500
Freddie Mac 3,000 % éch. 01/06/2052	207 754	192 951
Obligation internationale du gouvernement péruvien 6,150 % éch. 12/08/2032	PEN 759 959	178 463
Fannie Mae 4,000 % éch. 01/10/2051	$ 169 263	174 512
China Development Bank 2,890 % éch. 22/06/2025	CNY 1 048 500	166 075
Fannie Mae 3,500 % éch. 01/05/2052	$ 171 559	165 984
Freddie Mac 3,000 % éch. 01/07/2052	174 833	162 376
China Development Bank 4,150 % éch. 26/10/2025	CNY 933 800	154 016

(a) Le Fonds Income Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille Fonds Income Fund II

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 DÉCEMBRE 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		1 581 831	$	15 740
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Billets du Trésor américain 3,125 % éch. 15/08/2025	$	7 500		7 448
Billets du Trésor américain 2,750 % éch. 15/08/2032		5 500		5 378
Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 15/11/2032		3 600		3 692
Billets du Trésor américain 2,750 % éch. 15/05/2025		2 500		2 508
Harbour Energy PLC 5,044 % éch. 28/01/2054	£	2 000		2 149
Fannie Mae 3,500 % éch. 01/05/2052	$	1 892		1 815
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % éch. 01/08/2052		1 894		1 765
Billets du Trésor américain 4,000 % éch. 31/10/2029		1 700		1 719
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b)		1 428		1 316
Jupiter Mortgage PLC 6,676 % éch. 20/07/2060	£	900		1 002
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b)	$	725		712
Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/09/2029		700		699
Structured Asset Securities Corp. Mortgage Loan Trust 4,679 % éch. 25/07/2036		661		664
Structured Asset Investment Loan Trust 5,364 % éch. 25/05/2035		711		663
Home Equity Asset Trust 5,049 % éch. 25/04/2036		737		663
First Franklin Mortgage Loan Trust 4,129 % éch. 25/03/2036		731		663
Morgan Stanley Capital, Inc. Trust 4,944 % éch. 25/01/2036		900		659
Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042		600		610
New Century Home Equity Loan Trust 5,124 % éch. 25/10/2035		700		603

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		1 678 252	$	16 700
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Billets du Trésor américain 2,750 % éch. 15/08/2032	$	5 500		5 368
Fannie Mae 4,000 % éch. 01/03/2051		688		709
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b)		714		662
Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 15/11/2032		600		629
Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042		600		581
Morgan Stanley Home Equity Loan Trust 4,899 % éch. 25/02/2036		427		400
Kinbane DAC 2,744 % éch. 25/09/2062	€	400		386
Freddie Mac 4,000 % éch. 01/05/2049	$	268		276
Billets du Trésor américain 0,875 % éch. 15/11/2030		300		254
Community Health Systems, Inc. 6,125 % éch. 01/04/2030		400		248
T-Mobile USA, Inc. 3,500 % éch. 15/04/2031		250		222
Specialty Underwriting & Residential Finance Trust 2,794 % éch. 25/12/2035		200		195
U.S. Renal Care, Inc. 10,625 % éch. 15/07/2027		390		187
Boeing Co. 5,705 % éch. 01/05/2040		190		184
Imperial Brands Finance Netherlands BV 1,750 % éch. 18/03/2033	€	210		151
Magallanes, Inc. 4,054 % éch. 15/03/2029	$	150		138
Deutsche Bank AG 4,625 % éch. 30/10/2027	€	200		132
Obligation internationale du gouvernement péruvien 6,900 % éch. 12/08/2037	PEN	200		45
Petroleos Mexicanos 6,950 % éch. 28/01/2060	$	60		38

(a) Le Fonds Income Fund II est investi en actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Inflation Multi-Asset Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		8 381 274	$	83 404
Invesco Physical Gold ETC		286 921		51 698
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2032 (b)	$	40 733		43 011
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b)		35 146		33 521
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % éch. 15/05/2030	€	15 538		17 833
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2026 (b)	$	11 797		12 479
Obligation internationale du gouvernement espagnol 0,650 % éch. 30/11/2027	€	9 821		12 268
Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 10/08/2031	£	6 709		11 463
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % éch. 15/10/2027 (b)	$	11 130		11 275
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2027 (b)		10 023		10 144
		ACTIONS		
iShares Physical Gold ETC		288 780		10 090
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 10/03/2029	¥	1 217 509		9 119
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 2,000 % éch. 31/01/2025	ZAR	129 236		8 397
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2031	€	6 070		8 014
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,875 % éch. 15/02/2047 (b)	$	6 923		7 411
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2027 (b)		6 628		6 825
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % éch. 26/05/2025	€	4 780		5 817
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % éch. 10/03/2028	¥	763 516		5 686
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % éch. 15/05/2033	€	4 679		5 428
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/01/2028 (b)	$	5 026		5 326
Ginnie Mae 4,726 % éch. 20/10/2072		4 700		4 700

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		5 669 413	$	56 410
Invesco Physical Gold ETC		211 950		35 933
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/01/2032 (b)	$	33 031		31 788
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,400 % éch. 15/05/2030	€	21 772		24 093
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 2,000 % éch. 31/01/2025	ZAR	138 240		9 523
Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 10/08/2031	£	5 555		7 239
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2027 (b)	$	5 945		5 860
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2031 (b)		5 395		5 514
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/04/2022 (b)		5 436		5 474
Obligation internationale du gouvernement français 0,100 % éch. 25/07/2031	€	4 636		4 884
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 0,100 % éch. 15/05/2033		4 895		4 381
Obligation internationale du gouvernement français 0,250 % éch. 25/07/2024		3 320		3 427
		ACTIONS		
Cheniere Energy, Inc.		20 143		2 866
Williams Cos., Inc.		73 337		2 520
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Obligation internationale du gouvernement mexicain 4,500 % éch. 22/11/2035	MXN	46 318		2 503
		ACTIONS		
Targa Resources Corp.		30 899		2 366
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/01/2028 (b)	$	2 405		2 267
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % éch. 15/07/2029 (b)		2 218		2 039
		ACTIONS		
Enbridge, Inc.		39 492		1 830
Invesco Physical Gold ETC		10 640		1 825

(a) Le Fonds Inflation Multi-Asset Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Low Average Duration Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		52 138 023	$	518 809
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			
Billets du Trésor américain 0,875 % éch. 31/01/2024	$	244 100		240 906
Billets du Trésor américain 1,500 % éch. 29/02/2024		190 000		190 109
Billets du Trésor américain 4,375 % éch. 31/10/2024		88 200		88 149
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	176 300		12 622
Toronto-Dominion Bank 2,350 % éch. 08/03/2024	$	11 400		11 390
Morgan Stanley 2,630 % éch. 18/02/2026		10 700		10 700
Ginnie Mae 4,996 % éch. 20/11/2072		9 402		9 395
Ginnie Mae 4,986 % éch. 20/11/2072		8 300		8 293
Goldman Sachs Group, Inc. 3,000 % éch. 15/03/2024		8 300		8 293
Fannie Mae 3,000 % éch. 01/04/2052		8 200		8 033
Ripon Mortgages PLC 4,011 % éch. 28/08/2056	£	5 800		7 917
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % éch. 01/02/2052	$	7 789		7 914
Citigroup, Inc. 3,290 % éch. 17/03/2026		7 700		7 700
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	110 000		7 681
Rogers Communications, Inc. 2,950 % éch. 15/03/2025	$	7 600		7 595
Fortress Investment Group LLC 5,761 % éch. 23/02/2039		7 200		7 155
Morgan Stanley 3,620 % éch. 17/04/2025		5 000		5 000
Regatta Funding Ltd. 5,329 % éch. 17/10/2030		4 600		4 589
Commercial Mortgage Trust 3,147 % éch. 15/08/2045		4 519		4 523

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		54 840 016	$	545 700
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			
Toronto-Dominion Bank 2,350 % éch. 08/03/2024	$	11 400		11 016
Morgan Stanley 2,630 % éch. 18/02/2026		10 700		10 134
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	176 300		10 008
Citigroup, Inc. 3,290 % éch. 17/03/2026	$	7 700		7 360
Rogers Communications, Inc. 2,950 % éch. 15/03/2025		7 600		7 278
Volkswagen Financial Services NV 1,625 % éch. 30/11/2022	£	5 800		6 921
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	110 000		6 245
Goldman Sachs Group, Inc. 3,000 % éch. 15/03/2024	$	5 000		4 909
Morgan Stanley 3,620 % éch. 17/04/2025		5 000		4 884
Regatta Funding Ltd. 5,329 % éch. 17/10/2030		4 600		4 573
Obligation internationale du gouvernement péruvien 8,200 % éch. 12/08/2026	PEN	17 000		4 405
Citigroup, Inc. 4,140 % éch. 24/05/2025	$	4 000		4 035
Canadian Imperial Bank of Commerce 3,300 % éch. 07/04/2025		4 100		3 965
General Motors Financial Co., Inc. 3,800 % éch. 07/04/2025		4 000		3 947
International Business Machines Corp. 4,000 % éch. 27/07/2025		4 000		3 896
Capital One Financial Corp. 2,636 % éch. 03/03/2026		4 100		3 842
GoldenTree Loan Opportunities Ltd. 2,349 % éch. 29/10/2029		3 839		3 817
Madison Park Funding Ltd. 4,829 % éch. 15/04/2029		3 850		3 804
Bank of America Corp. 3,384 % éch. 02/04/2026		4 000		3 801

(a) Le Fonds Low Average Duration Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		26 190 692	$	260 619
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Billets du Trésor américain 4,375 % éch. 31/10/2024	$	23 100		23 105
Billets du Trésor américain 4,250 % éch. 15/10/2025		20 900		20 737
Billets du Trésor américain 1,500 % éch. 29/02/2024		20 500		20 495
Billets du Trésor américain 2,250 % éch. 31/03/2024		12 100		11 999
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR	139 500		10 408
Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 15/09/2025	$	6 700		6 579
Billets du Trésor américain 4,000 % éch. 15/12/2025		6 100		6 097
GSK Consumer Healthcare Capital NL BV 1,250 % éch. 29/03/2026	€	3 700		4 070
Energy Transfer LP 5,550 % éch. 15/02/2028	$	4 000		3 997
eBay, Inc. 5,900 % éch. 22/11/2025		4 000		3 995
Duke Energy Corp. 5,000 % éch. 08/12/2025		3 800		3 799
Weir Group PLC 2,200 % éch. 13/05/2026		3 800		3 626
Volkswagen Financial Services NV 5,500 % éch. 07/12/2026	£	3 000		3 602
Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. 4,875 % éch. 25/09/2025		3 000		3 552
Société Générale S.A. 4,677 % éch. 15/06/2027	$	3 500		3 500
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd. 3,800 % éch. 15/09/2022		3 300		3 339
American Medical Systems Europe BV 0,750 % éch. 08/03/2025	€	3 000		3 318
Nykredit Realkredit A/S 1,375 % éch. 12/07/2027		3 000		3 304
Protective Life Global Funding 4,714 % éch. 06/07/2027	$	3 300		3 300

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		34 006 764	$	338 400
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Billets du Trésor américain 1,500 % éch. 29/02/2024	$	20 500		19 897
Billets du Trésor américain 0,125 % éch. 31/08/2023		15 800		15 266
Billets du Trésor américain 0,125 % éch. 31/07/2023		8 200		7 953
Billets du Trésor américain 0,125 % éch. 30/06/2023		7 900		7 692
Billets du Trésor américain 0,625 % éch. 31/07/2026		5 200		4 964
Billets du Trésor américain 0,750 % éch. 30/04/2026		3 800		3 616
Goldman Sachs Group, Inc. 3,375 % éch. 27/03/2025	€	3 100		3 575
Billets du Trésor américain 0,750 % éch. 31/08/2026	$	3 500		3 358
Billets du Trésor américain 0,875 % éch. 30/09/2026		3 500		3 345
Banco BTG Pactual S.A. 5,500 % éch. 31/01/2023		3 200		3 233
Goldman Sachs Group, Inc. 3,000 % éch. 15/03/2024		3 200		3 148
Morgan Stanley 0,637 % éch. 26/07/2024	€	2 800		3 079
Equifax, Inc. 5,100 % éch. 15/12/2027	$	3 100		3 047
Billets du Trésor américain 0,750 % éch. 31/05/2026		3 200		3 026
UBS Group AG 4,125 % éch. 24/09/2025		3 000		2 967
Contemporary Ruiding Development Ltd. 1,500 % éch. 09/09/2026		3 300		2 933
Dell Bank International DAC 0,500 % éch. 27/10/2026	€	3 300		2 763
Sinopec Group Overseas Development Ltd. 2,500 % éch. 13/09/2022	$	2 600		2 598
Industrial & Commercial Bank of China Ltd. 1,000 % éch. 20/07/2023		2 500		2 461

(a) Le Fonds Low Duration Global Investment Grade Credit Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille
Fonds Low Duration Income Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		11 901 396	$	118 420
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Billets du Trésor américain 2,375 % éch. 31/03/2029	$	25 000		24 802
Temple Quay PLC 0,000 % éch. 24/07/2085	£	17 600		20 254
Canada Square Funding PLC 3,735 % éch. 17/01/2059		12 788		15 707
Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/09/2029	$	15 200		15 179
Credit Suisse Mortgage Capital Trust 6,218 % éch. 15/07/2032		15 277		15 049
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b)		12 579		12 340
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2024 (b)		10 170		9 903
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2023 (b)		9 648		9 569
Dufry One BV 2,500 % éch. 15/10/2024	€	8 142		9 157
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/04/2024 (b)	$	9 157		8 943
HSI Asset Securitization Corp. Trust 4,529 % éch. 25/12/2036		9 763		8 457
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b)		8 974		8 454
Lehman XS Trust 4,789 % éch. 25/08/2046		8 453		7 836
Magallanes, Inc. 3,788 % éch. 15/03/2025		7 700		7 700
Kinbane DAC 2,744 % éch. 25/09/2062	€	7 300		7 146
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b)	$	6 841		6 625
Billets du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2032		6 600		6 599
Harbour Energy PLC 3,844 % éch. 28/01/2054	£	5 284		6 506
Asset-Backed Securities Corp. Home Equity Loan Trust 3,479 % éch. 25/05/2036	$	6 856		6 350
Pacific Gas & Electric Co. 3,250 % éch. 16/02/2024		5 800		5 798
Uber Technologies, Inc. 7,500 % éch. 15/05/2025		5 100		5 334

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		14 535 746	$	144 620
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/09/2029	$	15 200		15 042
Scientific Games International, Inc. 1,000 % éch. 14/08/2024		10 696		10 696
Billets du Trésor américain 1,125 % éch. 15/02/2031		11 649		10 142
Billets du Trésor américain 2,375 % éch. 31/03/2029		9 400		9 091
Dufry One BV 2,500 % éch. 15/10/2024	€	8 142		8 365
CTP NV 0,625 % éch. 27/09/2026		7 400		8 002
Magallanes, Inc. 3,788 % éch. 15/03/2025	$	7 700		7 588
Hilton Domestic Operating Co., Inc. 3,750 % éch. 01/05/2029		8 800		7 545
Seagate HDD Cayman 3,375 % éch. 15/07/2031		9 300		7 468
Kraft Heinz Foods Co. 3,875 % éch. 15/05/2027		7 513		7 375
Pacific Gas & Electric Co. 3,250 % éch. 16/02/2024		5 800		5 727
Nissan Motor Co. Ltd. 2,652 % éch. 17/03/2026	€	3 993		4 756
VMware, Inc. 4,700 % éch. 15/05/2030	$	4 900		4 686
Barclays PLC 4,375 % éch. 15/03/2028		5 800		4 676
CommScope, Inc. 8,250 % éch. 01/03/2027		4 900		4 330
Pacific Gas & Electric Co. 4,250 % éch. 01/08/2023		3 699		3 718
Intercontinental Exchange, Inc. 3,650 % éch. 23/05/2025		3 650		3 619
Wynn Resorts Finance LLC 7,750 % éch. 15/04/2025		3 493		3 470
280 Park Avenue Mortgage Trust 5,117 % éch. 15/09/2034		3 300		3 233

(a) Le Fonds Low Duration Income Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Low Duration Opportunities Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		46 609 421	$	463 691
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Stratton BTL Mortgage Funding 3,656 % éch. 20/01/2054	£	11 200		15 181
Palmer Square European Loan Funding DAC 2,098 % éch. 15/10/2031	€	10 000		11 418
Boston Scientific Corp. 2,650 % éch. 01/06/2030	$	11 600		10 637
Billets du Trésor américain 1,375 % éch. 15/11/2031		10 200		9 813
Wells Fargo & Co. 3,526 % éch. 24/03/2028		8 500		8 500
Sasol Financing USA LLC 5,875 % éch. 27/03/2024		8 200		8 496
Harmony French Home Loans 2,558 % éch. 27/05/2062	€	7 500		8 412
Madison Park Funding Ltd. 4,829 % éch. 15/04/2029	$	8 017		7 956
Deutsche Bank AG 6,119 % éch. 14/07/2026		7 700		7 700
JPMorgan Chase & Co. 2,947 % éch. 24/02/2028		7 400		7 400
Sound Point CLO Ltd. 5,344 % éch. 18/04/2031		7 400		7 388
Southern California Edison Co. 2,750 % éch. 01/02/2032		7 900		7 265
Barley Hill PLC 4,352 % éch. 27/08/2058	£	5 200		7 082
Carbone CLO Ltd. 5,383 % éch. 20/01/2031	$	6 931		6 909
Bank of America Corp. 3,384 % éch. 02/04/2026		6 800		6 800
Citigroup, Inc. 3,785 % éch. 17/03/2033		6 500		6 500
TIAA CLO Ltd. 5,443 % éch. 20/07/2031		6 500		6 486
Voya CLO Ltd. 5,289 % éch. 15/10/2030		6 473		6 453
Goldman Sachs Group, Inc. 3,615 % éch. 15/03/2028		6 200		6 200

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		64 292 324	$	639 601
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Billets du Trésor américain 2,375 % éch. 31/01/2023	$	65 900		65 604
Billets du Trésor américain 0,750 % éch. 31/03/2026		50 600		47 973
Billets du Trésor américain 2,000 % éch. 30/11/2022		26 940		26 879
Billets du Trésor américain 2,125 % éch. 31/05/2026		23 200		23 579
Billets du Trésor américain 1,375 % éch. 31/10/2028		21 900		21 128
Billets du Trésor américain 1,875 % éch. 31/07/2026		17 700		17 777
Boston Scientific Corp. 2,650 % éch. 01/06/2030		18 300		16 292
Billets du Trésor américain 0,875 % éch. 30/06/2026		16 400		15 704
Dryden Euro CLO DAC 2,622 % éch. 15/05/2034	€	11 700		11 015
BNP Paribas S.A. 2,871 % éch. 19/04/2032	$	14 400		10 895
Standard Chartered PLC 2,819 % éch. 30/01/2026		11 100		10 149
Billets du Trésor américain 1,375 % éch. 15/11/2031		10 200		9 842
Palmer Square European Loan Funding DAC 2,098 % éch. 15/10/2031	€	9 929		9 409
Harvest CLO DAC 0,640 % éch. 15/10/2031		9 600		9 159
Aqueduct European CLO DAC 2,096 % éch. 20/07/2030		8 916		8 608
Ares European CLO DAC 2,582 % éch. 21/10/2033		8 000		7 699
Cairn CLO DAC 2,178 % éch. 30/04/2031		8 092		7 689
Madison Park Funding Ltd. 4,829 % éch. 15/04/2029	$	7 845		7 678
Boeing Co. 2,196 % éch. 04/02/2026		8 600		7 556

(a) Le Fonds Low Duration Opportunities Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille
Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		10 047	$	100
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
NatWest Group PLC 4,067 % éch. 06/09/2028	€	100		100
Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % éch. 05/09/2027		100		100
St. Paul's CLO DAC 2,128 % éch. 15/01/2032		100		98
NTT Finance Corp. 0,082 % éch. 13/12/2025		100		97
Mizuho Financial Group, Inc. 0,214 % éch. 07/10/2025		100		97
Banque européenne d'investissement 2,375 % éch. 24/05/2027	$	67		66
S&P Global, Inc. 4,750 % éch. 01/08/2028		48		50
Wells Fargo & Co. 4,540 % éch. 15/08/2026		50		50
Bank of America Corp. 2,456 % éch. 22/10/2025		52		50
Duke Energy Florida LLC 2,500 % éch. 01/12/2029		54		50
JPMorgan Chase & Co. 2,947 % éch. 24/02/2028		52		49
Goldman Sachs Group, Inc. 4,387 % éch. 15/06/2027		49		49
Citigroup, Inc. 4,615 % éch. 25/01/2026		50		48
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc. 3,741 % éch. 07/03/2029		50		48
Walt Disney Co. 2,200 % éch. 13/01/2028		52		48
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 1,900 % éch. 15/06/2028		54		48
Bank of Nova Scotia 5,245 % éch. 11/03/2024		48		48
Weyerhaeuser Co. 3,375 % éch. 09/03/2033		36		33
American Tower Corp. 1,450 % éch. 15/09/2026		36		32
Santander Holdings USA, Inc. 5,807 % éch. 09/09/2026		30		30
Xylem, Inc. 1,950 % éch. 30/01/2028		30		27
Magallanes, Inc. 4,054 % éch. 15/03/2029		28		26
Equinix, Inc. 1,550 % éch. 15/03/2028		30		26
HCA, Inc. 3,625 % éch. 15/03/2032		28		25
Equinix, Inc. 1,000 % éch. 15/09/2025		28		25
VeriSign, Inc. 2,700 % éch. 15/06/2031		30		25
Elevance Health, Inc. 2,550 % éch. 15/03/2031		28		25
Manulife Financial Corp. 3,703 % éch. 16/03/2032		26		25
Deutsche Bank AG 1,375 % éch. 10/06/2026	€	25		25
Equitable Financial Life Global Funding 1,300 % éch. 12/07/2026	$	28		25
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 1,875 % éch. 31/03/2028	€	27		25

DESCRIPTION	ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	10 047	$	100
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Corebridge Financial, Inc. 3,650 % éch. 05/04/2027	$ 18		16
Morgan Stanley 2,630 % éch. 18/02/2026	17		16
Aptiv PLC 3,250 % éch. 01/03/2032	18		15

(a) Le Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille
Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	2 110 946	$ 21 008
Pioneer Natural Resources Co.	18 400	4 511
Chesapeake Energy Corp.	41 800	3 479
Pembina Pipeline Corp.	81 200	3 131
EOG Resources, Inc.	26 800	3 129
Southwestern Energy Co.	359 600	2 980
EQT Corp.	64 900	2 901
EnLink Midstream LLC	292 900	2 900
Marathon Oil Corp.	110 400	2 636
Antero Resources Corp.	71 000	2 464
DTE Midstream LLC	43 500	2 429
Occidental Petroleum Corp.	37 066	2 301
ConocoPhillips	19 000	2 165
Range Resources Corp.	58 800	2 113
Devon Energy Corp.	30 200	2 074
Targa Resources Corp.	28 700	2 061
Equitrans Midstream Corp.	213 500	1 666
Diamondback Energy, Inc.	11 500	1 538
Coterra Energy, Inc.	55 200	1 279
ONEOK, Inc.	20 100	1 255
Ovintiv, Inc.	27 200	1 190

DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	1 879 296	$ 18 700
Hess Midstream LP	122 486	3 730
Coterra Energy, Inc.	107 791	3 599
Ovintiv, Inc.	65 000	3 289
Marathon Oil Corp.	111 700	3 193
Cheniere Energy, Inc.	19 700	2 917
Southwestern Energy Co.	359 600	2 736
Diamondback Energy, Inc.	16 500	2 578
EOG Resources, Inc.	18 100	2 223
Targa Resources Corp.	29 600	1 969
Rattler Midstream LP	131 100	1 933
Pioneer Natural Resources Co.	8 000	1 931
ONEOK, Inc.	31 100	1 923
Range Resources Corp.	58 800	1 820
Antero Resources Corp.	44 600	1 659
EQT Corp.	32 800	1 420
Williams Cos., Inc.	39 800	1 296
Enbridge, Inc.	28 600	1 223
Chesapeake Energy Corp.	10 500	1 031
Occidental Petroleum Corp.	11 000	710

(a) Le Fonds PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund est investi en actions d'un Fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Mortgage Opportunities Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS / VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		111 032 957	$ 1 105 032
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % éch. 01/09/2052	$	306 151	291 981
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % éch. 01/09/2052		281 439	276 674
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % éch. 01/11/2052		123 747	116 472
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % éch. 01/10/2052		124 557	113 469
Uniform Mortgage-Backed Security 5,000 % éch. 01/01/2053		100 000	99 316
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % éch. 01/10/2052		99 484	98 128
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % éch. 01/12/2052		99 604	94 472
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % éch. 01/04/2052		79 885	76 047
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % éch. 01/02/2051		19 801	17 630
Ginnie Mae 1,000 % éch. 20/03/2071		17 088	17 013
Ginnie Mae 1,000 % éch. 20/12/2070		16 121	16 317
Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC 5,018 % éch. 21/10/2028	£	11 400	15 426
Fannie Mae 3,500 % éch. 01/04/2052	$	15 500	15 367
Billets du Trésor américain 1,875 % éch. 15/02/2032		15 400	15 122
Ginnie Mae 1,000 % éch. 20/04/2071		13 869	14 112
Ginnie Mae 1,000 % éch. 20/09/2070		12 170	11 930
Cardiff Auto Receivables Securitisation PLC 6,318 % éch. 21/10/2028	£	8 775	11 874
KKR CLO Ltd. 2,444 % éch. 15/04/2031	$	10 800	10 638
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % éch. 01/08/2052		9 860	9 749

DESCRIPTION		ACTIONS / VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		120 374 756	$ 1 197 984
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % éch. 01/09/2052	$	306 151	289 535
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % éch. 01/09/2052		281 439	270 161
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % éch. 01/11/2052		123 747	120 271
Uniform Mortgage-Backed Security 4,000 % éch. 01/10/2052		124 557	118 188
Uniform Mortgage-Backed Security 4,500 % éch. 01/10/2052		99 484	94 553
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % éch. 01/04/2052		79 629	73 956
Fannie Mae 3,000 % éch. 01/06/2051		48 652	50 002
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % éch. 01/08/2051		54 848	47 577
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % éch. 01/05/2051		31 750	29 860
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % éch. 01/06/2051		27 297	25 672
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % éch. 01/05/2051		28 138	24 640
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % éch. 01/04/2051		24 249	22 473
Madison Park Euro Funding DAC 2,128 % éch. 15/01/2032	€	19 600	18 907
Uniform Mortgage-Backed Security 2,000 % éch. 01/04/2036	$	18 874	17 382
Ginnie Mae 1,000 % éch. 20/03/2071		17 088	16 981
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % éch. 01/04/2051		18 680	16 358
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % éch. 01/02/2051		19 546	16 194
Ginnie Mae 1,000 % éch. 20/12/2070		16 121	16 171
Uniform Mortgage-Backed Security 2,500 % éch. 01/01/2051		17 572	15 442

(a) Le Fonds Mortgage Opportunities Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds StocksPLUS™ Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		14 635 180	$ 145 629
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Shamrock Residential DAC 2,744 % éch. 24/01/2061	€	23 700	25 475
Ripon Mortgages PLC 4,011 % éch. 28/08/2056	£	14 200	19 383
Goldman Sachs Group, Inc. 2,905 % éch. 24/07/2023	$	16 390	16 542
Verus Securitization Trust 1,829 % éch. 25/10/2066		14 102	13 167
245 Park Avenue Trust 3,508 % éch. 05/06/2037		12 203	12 721
GS Mortgage Securities Trust 2,773 % éch. 10/11/2045		12 622	12 645
Lehman XS Trust 4,749 % éch. 25/07/2037		12 122	11 309
Bavarian Sky S.A. 2,448 % éch. 20/07/2029	€	10 528	11 112
Dutch Property Finance BV 3,328 % éch. 28/04/2050		9 579	9 989
Nationstar Home Equity Loan Trust 4,709 % éch. 25/04/2037	$	10 004	9 828
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/02/2052 (b)		10 686	9 464
Dutch Property Finance BV 2,828 % éch. 28/04/2050	€	8 000	8 645
Obligation internationale du gouvernement israélien 0,750 % éch. 31/07/2022	ILS	23 800	7 052
BX Trust 5,338 % éch. 15/05/2035	$	7 010	6 975
GA Global Funding Trust 5,085 % éch. 11/04/2025		6 800	6 800
Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust 1,884 % éch. 25/08/2036		6 935	6 781
Polaris PLC 4,232 % éch. 23/10/2059	£	5 000	6 696
Bumper NL BV 3,110 % éch. 24/06/2031	€	5 676	6 006
Navient Private Education Loan Trust 5,768 % éch. 16/07/2040	$	5 868	5 926
Ameriquest Mortgage Securities, Inc. Asset-Backed Pass-Through Certificates 5,304 % éch. 25/09/2035		6 000	5 895
Countrywide Asset-Backed Certificates 4,889 % éch. 25/01/2046		5 985	5 882
Structured Asset Investment Loan Trust 4,569 % éch. 25/09/2036		7 692	5 585

DESCRIPTION		ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		39 701 373	$ 395 100
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Billets du Trésor américain 2,875 % éch. 30/09/2023	$	75 980	76 511
Harvest CLO DAC 2,228 % éch. 15/01/2032	€	28 500	27 964
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/01/2028 (b)	$	25 512	26 208
		ACTIONS	
Amazon.com, Inc.		9 000	25 676
		VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Bank of America Corp. 2,863 % éch. 24/08/2025	€	23 500	24 600
Madison Park Euro Funding DAC 2,128 % éch. 15/01/2032		24 700	23 937
Trinity Square PLC 3,729 % éch. 15/07/2059	£	19 177	23 897
Towd Point Mortgage Funding PLC 3,826 % éch. 20/07/2045		18 354	22 999
Ares European CLO DAC 2,306 % éch. 20/04/2032	€	14 100	14 007
Twin Bridges PLC 1,412 % éch. 12/09/2055	£	11 540	13 348
Obligations du Trésor américain 3,000 % éch. 15/02/2049	$	13 000	12 778
Griffith Park CLO DAC 2,522 % éch. 21/11/2031	€	11 600	11 329
Marvell Technology, Inc. 4,200 % éch. 22/06/2023	$	11 025	11 138
GS Mortgage Securities Trust 2,773 % éch. 10/11/2045		10 854	10 853
Obligation internationale du gouvernement israélien 0,750 % éch. 31/07/2022	ILS	35 700	10 579
GS Mortgage Securities Trust 4,074 % éch. 10/01/2047	$	9 886	9 880
BX Trust 2,124 % éch. 15/05/2030		10 000	9 720
Billets du Trésor américain 3,000 % éch. 31/10/2025		9 600	9 658
Billets du Trésor américain 3,000 % éch. 30/09/2025		9 600	9 658

(a) Le Fonds StocksPLUS™ Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	41 168	$ 410
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Billets du Trésor américain 3,000 % éch. 15/07/2025	$ 300	300
Mountain View CLO Ltd. 5,291 % éch. 13/10/2027	250	247
Nykredit Realkredit A/S 1,500 % éch. 01/10/2053	DKK 800	111
Dutch Property Finance BV 2,828 % éch. 28/04/2050	€ 100	108
Shamrock Residential DAC 2,744 % éch. 24/01/2061	100	107
245 Park Avenue Trust 3,508 % éch. 05/06/2037	$ 100	105
Palmer Square European Loan Funding DAC 3,993 % éch. 12/04/2032	€ 100	100
Goldman Sachs Group, Inc. 6,162 % éch. 15/03/2028	$ 100	100
Magallanes, Inc. 4,279 % éch. 15/03/2032	100	100
LoanCore Issuer Ltd. 2,624 % éch. 15/07/2036	100	98

DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	60 287	$ 600
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Billets du Trésor américain 3,000 % éch. 15/07/2025	$ 300	292
Billets du Trésor américain 1,125 % éch. 15/02/2031	300	279
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,000 % éch. 15/02/2046 (b)	125	111
LoanCore Issuer Ltd. 2,624 % éch. 15/07/2036	100	97
Boeing Co. 2,750 % éch. 01/02/2026	104	95
T-Mobile USA, Inc. 2,250 % éch. 15/02/2026	100	90
Obligation internationale du gouvernement péruvien 5,400 % éch. 12/08/2034	PEN 100	20

(a) Le Fonds PIMCO StocksPLUS™ AR Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Strategic Income Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	34 135 038	$ 339 685
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Billets du Trésor américain 2,875 % éch. 30/04/2029	$ 8 700	8 587
ACE Securities Corp. Home Equity Loan Trust 4,869 % éch. 25/04/2036	8 149	7 266
Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/09/2029	5 200	5 193
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b)	4 375	4 292
	ACTIONS	
Johnson & Johnson	24 555	4 269
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Billets du Trésor américain 2,375 % éch. 31/03/2029	$ 4 200	4 167
	ACTIONS	
Roche Holding AG	11 604	3 935
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % éch. 25/01/2030	$ 3 988	3 888
	ACTIONS	
Exxon Mobil Corp.	39 552	3 686
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % éch. 15/07/2023 (b)	$ 3 704	3 673
	ACTIONS	
Novartis AG	42 236	3 671
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Billets du Trésor américain 4,000 % éch. 31/10/2029	$ 3 600	3 594
	ACTIONS	
VICI Properties, Inc.	105 328	3 554
Gaming and Leisure Properties, Inc.	66 928	3 505
Merck & Co., Inc.	38 920	3 441
Cisco Systems, Inc.	74 369	3 396
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2024 (b)	$ 3 444	3 354
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % éch. 15/04/2024 (b)	3 280	3 203
	ACTIONS	
AT&T, Inc.	150 226	3 110

DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	32 678 695	$ 325 180
Exxon Mobil Corp.	127 205	11 298
Chevron Corp.	68 359	10 382
TotalEnergies SE	140 034	7 085
AT&T, Inc.	342 312	6 605
Valero Energy Corp.	53 697	5 758
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Billets du Trésor américain 2,625 % éch. 31/01/2026	$ 5 700	5 665
Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/09/2029	5 200	5 148
	ACTIONS	
Altria Group, Inc.	98 317	4 698
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
INEOS Finance PLC 3,898 % éch. 01/04/2024	€ 4 325	4 553
	ACTIONS	
Telefonica S.A.	857 149	3 895
International Business Machines Corp.	28 054	3 645
Verizon Communications, Inc.	78 193	3 635
AbbVie, Inc.	23 359	3 526
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
American Airlines, Inc. 5,500 % éch. 20/04/2026	$ 3 457	3 318
	ACTIONS	
AXA S.A.	135 100	3 137
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
iHeartCommunications, Inc. 7,384 % éch. 01/05/2026	$ 3 320	3 121
Ford Motor Credit Co. LLC 3,250 % éch. 15/09/2025	€ 3 244	3 032
	ACTIONS	
BHP Group Ltd.	111 015	3 019
Softbank Corp.	253 000	2 942

(a) Le Fonds Strategic Income Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds Total Return Bond Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		42 778 551	$	425 671
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % éch. 01/05/2052	$	93 015		86 601
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % éch. 01/09/2052		56 808		52 918
Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042		34 100		33 977
Obligation internationale du gouvernement canadien 2,250 % éch. 01/12/2029	CAD	38 600		30 491
Obligations du Trésor américain 3,375 % éch. 15/08/2042	$	30 400		30 458
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/01/2024 (b)		30 572		29 963
Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042		26 600		26 798
Ripon Mortgages PLC 4,011 % éch. 28/08/2056	£	17 600		24 024
Billets du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2032	$	25 000		23 973
Freddie Mac 3,000 % éch. 01/07/2052		18 998		17 998
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/10/2024 (b)		17 883		17 246
Billets du Trésor américain 1,875 % éch. 28/02/2027		16 700		16 755
Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 03/08/2022	ILS	54 380		16 526
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % éch. 15/07/2031 (b)	$	17 592		15 578
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % éch. 15/07/2032 (b)		15 917		14 712
Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2052		13 100		14 214
Palmer Square European Loan Funding DAC 2,098 % éch. 15/10/2031	€	11 700		13 358
Enel Finance International NV 2,875 % éch. 11/04/2029	£	10 000		13 109
Credit Suisse Group AG 6,537 % éch. 12/08/2033	$	13 000		13 000

DESCRIPTION		ACTIONS		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		3 260 360	$	322 876
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		22 846 750		227 400
	VALEUR NOMINALE (en milliers)			
Lloyds Banking Group PLC 7,625 % éch. 27/06/2023	£	57 070		78 251
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % éch. 01/05/2052	$	55 000		52 310
Uniform Mortgage-Backed Security 3,000 % éch. 01/09/2052		56 388		47 804
Obligations du Trésor américain 1,375 % éch. 15/08/2050		62 700		46 586
Obligations du Trésor américain 3,000 % éch. 15/11/2044		33 200		38 005
Obligation internationale du gouvernement péruvien 6,150 % éch. 12/08/2032	PEN	77 900		18 248
RCI Banque S.A. 2,000 % éch. 11/07/2024	€	18 600		17 911
Unipol Gruppo SpA 3,250 % éch. 23/09/2030		20 900		17 563
Grupo Aval Ltd. 4,750 % éch. 26/09/2022	$	17 000		17 107
Obligation internationale du gouvernement qatari 3,875 % éch. 23/04/2023		16 400		16 622
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands BV 6,000 % éch. 15/04/2024		15 700		15 694
AT&T, Inc. 1,650 % éch. 01/02/2028		18 100		15 325
Los Angeles Community College District, California General Obligation Notes, Series 2020 1,606 % éch. 01/08/2028		15 800		15 315
Obligation internationale du gouvernement israélien 3,800 % éch. 13/05/2060		18 400		14 766
Shinhan Bank Co. Ltd. 0,250 % éch. 16/10/2024	€	14 000		14 167
Evergy, Inc. 2,450 % éch. 15/09/2024	$	12 600		11 970
Boeing Co. 2,750 % éch. 01/02/2026		12 600		11 739
Obligations du Trésor américain 1,625 % éch. 15/11/2050		18 100		11 714

(a) Le Fonds Total Return Bond Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

(b) Le montant principal du titre est ajusté pour tenir compte de l'inflation.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille
Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		ACTIONS	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		8 846 240	$ 88 028
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)		290 650	28 629
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Bons du Trésor japonais 0,000 % éch. 24/10/2022	¥	1 670 600	12 285
Bons du Trésor israélien 0,000 % éch. 08/02/2023	ILS	26 700	7 652
Heineken NV 2,750 % éch. 01/04/2023	$	4 000	3 973
Leidos, Inc. 2,950 % éch. 15/05/2023		3 685	3 646
Baxter International, Inc. 4,495 % éch. 01/12/2023		3 500	3 470
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 0,875 % éch. 18/09/2023		3 600	3 467
Goldman Sachs Group, Inc. 2,009 % éch. 06/12/2023		3 440	3 411
Nationwide Building Society 3,766 % éch. 08/03/2024		3 400	3 380
Bank of America Corp. 3,004 % éch. 20/12/2023		3 240	3 229
Nomura Holdings, Inc. 2,648 % éch. 16/01/2025		3 300	3 090
Niagara Mohawk Power Corp. 2,721 % éch. 28/11/2022		3 000	2 996
ORIX Corp. 4,050 % éch. 16/01/2024		3 000	2 963
Time Warner Entertainment Co. LP 8,375 % éch. 15/03/2023		2 793	2 843
Bayer U.S. Finance LLC 5,779 % éch. 15/12/2023		2 800	2 796
Sydney Airport Finance Co. Pty. Ltd. 3,900 % éch. 22/03/2023		2 762	2 749
Goldman Sachs Group, Inc. 6,334 % éch. 29/11/2023		2 700	2 713
British Telecommunications PLC 4,500 % éch. 04/12/2023		2 700	2 665
Canadian Imperial Bank of Commerce 5,122 % éch. 17/03/2023		2 500	2 500

DESCRIPTION		ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022			
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)		8 005 161	$ 79 650
	VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Jackson National Life Global Funding 4,278 % éch. 06/01/2023	$	1 605	1 605
Ginnie Mae 4,642 % éch. 20/05/2066		1 213	1 226
Goldman Sachs Group, Inc. 2,009 % éch. 06/12/2023		1 000	992
Amazon.com, Inc. 2,730 % éch. 13/04/2024		1 000	977
Korea Expressway Corp. 1,956 % éch. 02/09/2023	AUD	1 000	674
Mountain View CLO LLC 5,169 % éch. 16/10/2029	$	563	558
Venture CLO Ltd. 5,293 % éch. 20/07/2030		400	395

(a) Le Fonds PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds UK Corporate Bond Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 31/01/2023	£	107 900	£	107 027
Bon du Trésor britannique 1,750 % éch. 07/09/2022		69 450		69 502
Bon du Trésor britannique 0,500 % éch. 22/07/2022		66 380		66 362
Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 22/07/2027		23 000		19 990
Bon du Trésor britannique 4,250 % éch. 07/03/2036		6 800		6 685
Bon du Trésor britannique 4,000 % éch. 07/03/2022		5 750		5 774
		ACTIONS		
PIMCO ETFs plc - PIMCO Sterling Short Maturity UCITS ETF (a)		51 000		5 173
		VALEUR NOMINALE (en milliers)		
Volkswagen Financial Services NV 2,125 % éch. 18/01/2028	£	3 700		3 547
Goldman Sachs Group, Inc. 3,625 % éch. 29/10/2029		3 500		3 489
South Eastern Power Networks PLC 1,750 % éch. 30/09/2034		4 200		3 450
Bons du trésor britannique 0,000 % éch. 04/04/2022		3 300		3 300
Motability Operations Group PLC 2,125 % éch. 18/01/2042		3 300		3 244
London & Quadrant Housing Trust 2,000 % éch. 31/03/2032		3 200		3 173
Credit Suisse Group AG 7,375 % éch. 07/09/2033		3 000		2 982
Bank of America Corp. 3,584 % éch. 27/04/2031		2 800		2 799
Santander UK Group Holdings PLC 2,421 % éch. 17/01/2029		2 600		2 600
Sage Group PLC 2,875 % éch. 08/02/2034		2 500		2 486
Barclays PLC 3,250 % éch. 17/01/2033		2 500		2 235
BNP Paribas S.A. 0,875 % éch. 11/07/2030	€	2 700		2 233
Nestle Holdings, Inc. 2,500 % éch. 04/04/2032	£	2 000		2 000

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
Bon du Trésor britannique 0,500 % éch. 22/07/2022	£	66 380	£	66 362
Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 31/01/2023		40 300		40 105
Bon du Trésor britannique 1,250 % éch. 22/07/2027		23 000		20 737
Bon du Trésor britannique 0,875 % éch. 31/07/2033		16 700		13 280
Bon du Trésor britannique 1,750 % éch. 07/09/2022		10 200		10 202
Bon du Trésor britannique 4,000 % éch. 07/03/2022		9 200		9 231
Credit Suisse Group AG 2,125 % éch. 15/11/2029		4 300		3 430
Obligation internationale du gouvernement italien 6,000 % éch. 04/08/2028		2 500		3 032
TP ICAP Finance PLC 2,625 % éch. 18/11/2028		3 250		2 664
MPT Operating Partnership LP 2,500 % éch. 24/03/2026		2 900		2 561
Aroundtown S.A. 3,000 % éch. 16/10/2029		3 000		2 512
London & Quadrant Housing Trust 2,000 % éch. 31/03/2032		3 200		2 419
BNP Paribas S.A. 0,875 % éch. 11/07/2030	€	2 700		2 145
Enel Finance International NV 2,650 % éch. 10/09/2024	$	2 800		2 118
Bank of America Corp. 1,667 % éch. 02/06/2029	£	2 183		1 977
Derwent London PLC 1,875 % éch. 17/11/2031		2 300		1 915
BNP Paribas S.A. 2,000 % éch. 24/05/2031		2 000		1 886
AT&T, Inc. 4,250 % éch. 01/06/2043		2 000		1 870
Bon du Trésor britannique 1,500 % éch. 31/07/2053		1 800		1 846
Eastern Power Networks PLC 1,875 % éch. 01/06/2035		2 100		1 830

(a) Le Fonds UK Corporate Bond Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds UK Long Term Corporate Bond Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022				
Bon du Trésor britannique 0,500 % éch. 22/07/2022	£	17 900	£	17 887
Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 31/01/2023		16 000		15 899
Bon du Trésor britannique 3,750 % éch. 22/07/2052		16 400		14 744
Bons du trésor britannique 0,000 % éch. 08/05/2023		11 900		11 695
Bon du Trésor britannique 1,500 % éch. 31/07/2053		9 800		10 015
Bon du Trésor britannique 4,000 % éch. 07/03/2022		9 900		9 937
Bon du Trésor britannique 1,750 % éch. 07/09/2022		6 400		6 402
Électricité de France S.A. 5,500 % éch. 17/10/2041		3 300		3 140
South Eastern Power Networks PLC 1,750 % éch. 30/09/2034		4 400		3 133
London & Quadrant Housing Trust 2,000 % éch. 31/03/2032		3 000		2 928
GlaxoSmithKline Capital PLC 1,625 % éch. 12/05/2035		3 300		2 709
Motability Operations Group PLC 2,125 % éch. 18/01/2042		2 600		2 343
Goldman Sachs Group, Inc. 3,625 % éch. 29/10/2029		2 300		2 293
Citigroup, Inc. 6,800 % éch. 25/06/2038		2 000		2 205
E.ON International Finance BV 5,875 % éch. 30/10/2037		2 000		2 201
Orsted A/S 5,375 % éch. 13/09/2042		2 100		2 094
Deutsche Bank AG 1,875 % éch. 22/12/2028		2 700		2 081
Bon du Trésor britannique 1,500 % éch. 22/07/2047		3 800		2 075
Bon du Trésor britannique 1,750 % éch. 22/07/2057		3 800		2 045
Verizon Communications, Inc. 3,375 % éch. 27/10/2036		2 000		1 981

DESCRIPTION		VALEUR NOMINALE (en milliers)		PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022				
Bon du Trésor britannique 0,500 % éch. 22/07/2022	£	17 900	£	17 888
Bon du Trésor britannique 3,750 % éch. 22/07/2052		16 400		16 118
Bon du Trésor britannique 4,000 % éch. 07/03/2022		15 500		15 550
Bon du Trésor britannique 0,125 % éch. 31/01/2023		8 500		8 461
Bon du Trésor britannique 1,750 % éch. 07/09/2022		6 400		6 402
Bon du Trésor britannique 1,500 % éch. 31/07/2053		9 800		6 018
Bon du Trésor britannique 3,500 % éch. 22/01/2045		5 100		4 944
Bon du Trésor britannique 0,875 % éch. 31/07/2033		3 200		2 326
Bon du Trésor britannique 4,000 % éch. 22/01/2060		2 300		2 158
E.ON International Finance BV 4,750 % éch. 31/01/2034		2 000		2 045
Bon du Trésor britannique 0,500 % éch. 22/10/2061		5 900		1 997
Électricité de France S.A. 2,625 % éch. 01/12/2027	€	3 000		1 951
HomeBanc Mortgage Trust 2,629 % éch. 25/07/2035	$	2 557		1 877
GlaxoSmithKline Capital, Inc. 4,200 % éch. 18/03/2043		2 000		1 668
perating Partnership LP 3,375 % éch. 24/04/2030	£	1 800		1 408
Deutsche Bank AG 3,547 % éch. 18/09/2031	$	2 000		1 364
TP ICAP Finance PLC 2,625 % éch. 18/11/2028	£	1 800		1 352
Aroundtown S.A. 3,625 % éch. 10/04/2031		1 550		1 352
Mondelez International Holdings Netherlands BV 1,250 % éch. 09/09/2041	€	1 700		1 291
M&G PLC 6,340 % éch. 19/12/2063	£	1 100		1 274

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille
Fonds US High Yield Bond Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	89 637 626	$ 892 265
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Billets du Trésor américain 4,250 % éch. 15/10/2025	$ 73 000	72 304
Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/11/2027	50 700	50 741
Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 15/09/2025	50 000	49 307
Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 30/09/2027	25 000	24 916
Billets du Trésor américain 3,125 % éch. 31/08/2027	25 000	24 434
Condor Merger Sub, Inc. 7,375 % éch. 15/02/2030	15 000	14 970
Intelsat Jackson Holdings S.A. 6,500 % éch. 25/01/2030	11 249	10 968
Minerva Merger Sub, Inc. 6,500 % éch. 15/02/2030	10 000	9 844
Clydesdale Acquisition Holdings, Inc. 8,750 % éch. 15/04/2030	10 000	9 398
Billets du Trésor américain 4,125 % éch. 31/10/2027	9 000	8 896
Scientific Games Holdings LP 6,625 % éch. 01/03/2030	8 750	8 750
Fertitta Entertainment LLC 6,750 % éch. 15/01/2030	7 750	7 750
Ford Motor Credit Co. LLC 2,900 % éch. 10/02/2029	8 000	7 740
Royal Caribbean Cruises Ltd. 5,500 % éch. 31/08/2026	7 000	5 992
Cloud Software Group Holdings, Inc. 6,500 % éch. 31/03/2029	7 000	5 847
Ctec GmbH 5,250 % éch. 15/02/2030	€ 5 000	5 510
Diamond Sports Group LLC 12,317 % éch. 25/05/2026	$ 5 474	5 278
Tenet Healthcare Corp. 6,125 % éch. 15/06/2030	5 000	5 000
Royal Caribbean Cruises Ltd. 4,250 % éch. 01/07/2026	5 000	4 170

DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	111 298 968	$ 1 107 831
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Kraft Heinz Foods Co. 5,200 % éch. 15/07/2045	$ 15 000	16 247
Sprint Corp. 7,875 % éch. 15/09/2023	10 000	10 849
USI, Inc. 6,875 % éch. 01/05/2025	10 000	9 745
Chobani LLC 7,500 % éch. 15/04/2025	10 000	9 375
CNX Resources Corp. 6,000 % éch. 15/01/2029	8 500	8 827
Freeport-McMoRan, Inc. 5,400 % éch. 14/11/2034	7 400	8 456
Surgery Center Holdings, Inc. 8,050 % éch. 31/08/2026	8 393	8 424
	ACTIONS	
Noble Corp.	233 685	8 261
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Caesars Entertainment, Inc. 8,125 % éch. 01/07/2027	$ 8 000	8 256
BroadStreet Partners, Inc. 5,875 % éch. 15/04/2029	10 000	8 046
Kronos Acquisition Holdings, Inc. 7,000 % éch. 31/12/2027	9 750	7 685
H-Food Holdings LLC 8,500 % éch. 01/06/2026	11 000	7 393
Surgery Center Holdings, Inc. 10,000 % éch. 15/04/2027	7 000	7 315
	ACTIONS	
Noble Corp. PLC	205 228	7 287
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
HCA, Inc. 3,500 % éch. 01/09/2030	$ 8 000	7 087
Endurance International Group Holdings, Inc. 6,000 % éch. 15/02/2029	9 500	7 065
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc. 9,750 % éch. 01/12/2026	7 000	6 813
T-Mobile USA, Inc. 3,500 % éch. 15/04/2031	7 000	6 437
Full House Resorts, Inc. 8,250 % éch. 15/02/2028	7 250	6 434

(a) Le Fonds US High Yield Bond Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION	ACTIONS	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	33 429 538	$ 332 638
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Billets du Trésor américain 1,875 % éch. 15/02/2032	$ 25 301	24 864
Billets du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2032	17 234	17 296
Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/11/2051	16 494	15 274
Obligations du Trésor américain 4,000 % éch. 15/11/2042	13 700	13 911
Obligations du Trésor américain 2,000 % éch. 15/11/2041	8 100	7 961
Obligations du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2052	8 200	7 825
Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/09/2029	7 300	7 290
Obligations du Trésor américain 2,500 % éch. 15/02/2045	7 300	5 661
Obligation internationale du gouvernement sud-africain 10,500 % éch. 21/12/2026	ZAR 65 000	4 840
Meta Platforms, Inc. 3,850 % éch. 15/08/2032	$ 3 000	2 985
Credit Suisse Group AG 6,537 % éch. 12/08/2033	2 750	2 750
Obligations du Trésor américain 3,250 % éch. 15/05/2042	2 764	2 719
Obligations du Trésor américain 2,250 % éch. 15/02/2052	3 200	2 682
GSK Consumer Healthcare Capital U.S. LLC 3,375 % éch. 24/03/2029	2 650	2 623
Obligations du Trésor américain 3,375 % éch. 15/08/2042	2 800	2 386
American Tower Corp. 3,650 % éch. 15/03/2027	2 300	2 289
Expedia Group, Inc. 5,000 % éch. 15/02/2026	2 200	2 214
Wells Fargo & Co. 4,897 % éch. 25/07/2033	2 100	2 153
Nomura Holdings, Inc. 5,386 % éch. 06/07/2027	2 100	2 100

DESCRIPTION	ACTIONS	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022		
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	29 556 280	$ 294 100
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Billets du Trésor américain 2,375 % éch. 15/05/2051	$ 29 949	27 085
Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/02/2041	30 700	25 230
Billets du Trésor américain 1,875 % éch. 15/02/2032	25 301	23 062
Obligations du Trésor américain 1,875 % éch. 15/11/2051	16 494	13 667
Billets du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2032	10 933	10 787
Atlantia SpA 1,875 % éch. 12/02/2028	€ 9 000	8 404
Dell International LLC 6,020 % éch. 15/06/2026	$ 7 000	7 357
Billets du Trésor américain 3,875 % éch. 30/09/2029	7 300	7 356
Obligations du Trésor américain 2,000 % éch. 15/11/2041	8 100	6 728
Obligations du Trésor américain 1,750 % éch. 15/08/2041	8 100	6 446
JPMorgan Chase & Co. 3,960 % éch. 29/01/2027	6 100	6 112
Obligations du Trésor américain 2,250 % éch. 15/05/2041	6 000	5 224
Boeing Co. 5,150 % éch. 01/05/2030	4 300	4 574
Obligations du Trésor américain 2,875 % éch. 15/05/2052	5 600	4 332
HSBC Holdings PLC 3,973 % éch. 22/05/2030	4 600	4 329
Obligations du Trésor américain 1,375 % éch. 15/08/2050	5 700	4 168
Sempra Energy 3,250 % éch. 15/06/2027	3 889	3 994
VMware, Inc. 3,900 % éch. 21/08/2027	3 695	3 895
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 1,474 % éch. 08/07/2025	4 100	3 779

(a) Le Fonds US Investment Grade Corporate Bond Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Variations importantes de la composition du portefeuille

Fonds US Short-Term Fund

31 décembre 2022 (non auditées)

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	COÛT (en milliers)
ACHATS JUSQU'AU 31 décembre 2022		
Billets du Trésor américain 1,500 % éch. 29/02/2024	$ 243 200	$ 240 232
	ACTIONS	
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	14 217 950	141 530
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Billets du Trésor américain 2,500 % éch. 31/05/2024	$ 117 700	117 364
Billets du Trésor américain 2,750 % éch. 15/05/2025	72 200	72 034
Billets du Trésor américain 3,500 % éch. 15/09/2025	63 700	63 222
Billets du Trésor américain 2,500 % éch. 30/04/2024	51 000	51 000
Billets du Trésor américain 2,250 % éch. 31/03/2024	40 400	40 310
Federal Home Loan Bank 5,400 % éch. 21/11/2024	35 000	35 000
Sabine Pass Liquefaction LLC 5,625 % éch. 15/04/2023	23 945	24 351
Freddie Mac 5,400 % éch. 23/12/2024	20 000	20 000
Stellantis NV 5,250 % éch. 15/04/2023	18 137	18 457
Wells Fargo & Co. 5,241 % éch. 25/04/2026	18 400	18 400
NextEra Energy Capital Holdings, Inc. 5,342 % éch. 21/03/2024	17 700	17 686
Volkswagen Group of America Finance LLC 3,950 % éch. 06/06/2025	15 700	15 693
UBS Group AG 5,706 % éch. 12/05/2026	15 000	15 000
Billets du Trésor américain 0,875 % éch. 31/01/2024	14 900	14 707
ING Groep NV 5,963 % éch. 28/03/2026	13 100	13 100
General Motors Financial Co., Inc. 3,250 % éch. 05/01/2023	12 335	12 391
Standard Chartered PLC 6,063 % éch. 30/03/2026	12 000	12 000
Société Générale S.A. 2,625 % éch. 22/01/2025	11 600	11 490

DESCRIPTION	VALEUR NOMINALE (en milliers)	PRODUIT (en milliers)
VENTES JUSQU'AU 31 décembre 2022		
Billets du Trésor américain 2,250 % éch. 31/03/2024	$ 223 700	$ 220 815
Billets du Trésor américain 0,125 % éch. 31/03/2023	182 300	180 142
Billets du Trésor américain 0,750 % éch. 15/11/2024	172 800	164 548
	ACTIONS	
PIMCO Select Funds plc - Fonds PIMCO US Dollar Short-Term Floating NAV Fund (a)	14 214 803	141 500
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Billets du Trésor américain 2,500 % éch. 31/05/2024	$ 117 700	116 443
Billets du Trésor américain 2,750 % éch. 15/05/2025	72 200	70 279
Freddie Mac 0,650 % éch. 22/10/2025	57 000	55 310
Freddie Mac 0,800 % éch. 28/10/2026	60 000	53 255
Billets du Trésor américain 2,500 % éch. 30/04/2024	51 000	50 446
Billets du Trésor américain 1,500 % éch. 29/02/2024	50 500	49 726
Freddie Mac 0,800 % éch. 27/10/2026	50 000	46 089
Billets du Trésor américain 1,000 % éch. 15/12/2024	43 100	42 329
Federal Home Loan Bank 1,020 % éch. 24/02/2027	45 000	41 738
	ACTIONS	
PIMCO ETFs plc - Fonds PIMCO US Dollar Short Maturity UCITS ETF (a)	383 025	38 045
	VALEUR NOMINALE (en milliers)	
Federal Home Loan Bank 0,830 % éch. 10/02/2027	$ 37 000	33 035
Federal Home Loan Bank 0,850 % éch. 17/02/2027	33 500	29 952
Federal Home Loan Bank 0,920 % éch. 26/02/2027	29 100	25 952
Federal Home Loan Bank 0,750 % éch. 24/02/2026	28 000	25 592
Federal Home Loan Bank 0,800 % éch. 27/11/2023	26 000	25 079
Fannie Mae 0,700 % éch. 30/07/2025	22 000	20 379
Fannie Mae 0,875 % éch. 18/12/2026	21 000	19 524

(a) Le Fonds US Short-Term Fund est investi en actions d'un fonds affilié.

Les variations importantes du Portefeuille sont définies comme la valeur des achats qui dépassent 1 % du coût total des achats et des ventes qui dépassent 1 % du total des produits. Au moins vingt des plus grands achats et vingt des plus grandes ventes doivent être présentés. Si moins de vingt de ces opérations sont dénombrées, elles sont toutes divulguées.

Les Contrats de mise en pension, qui peuvent être utilisés comme liquidités non investies du Fonds et dont l'échéance est normalement le jour ouvrable suivant, et les titres détenus jusqu'à l'échéance, qui sont arrivés à échéance pendant la période considérée, ont été exclus des Variations importantes de la composition du Portefeuille.

Taux de rotation du portefeuille

Le présent rapport a été préparé à l'appui des communications aux investisseurs institutionnels dans le cadre de la Directive sur les droits des actionnaires II.

La durée pendant laquelle un Fonds a détenu un titre donné n'est généralement pas prise en compte lors des décisions d'investissement. Un changement apporté aux titres détenus par un Fonds est appelé « rotation de portefeuille ». Pour atteindre son objectif d'investissement, chaque Fonds peut procéder à des transactions fréquentes et actives de titres de portefeuille, en particulier dans des périodes de fluctuations volatiles du marché. Un taux de rotation élevé peut impliquer des frais de transaction correspondants supérieurs pour le portefeuille, notamment des commissions de courtage ou les marges bénéficiaires des courtiers et autres frais de transaction sur la vente de titres et le réinvestissement dans d'autres titres, qui sont supportés par le Fonds. De telles ventes peuvent entraîner la réalisation de plus-values imposables, notamment des plus-values à court terme (qui sont généralement imposées aux taux d'impôt sur le revenu habituel lorsqu'elles sont distribuées aux actionnaires). Les frais de transaction associés au taux de rotation des portefeuilles peuvent peser sur la performance d'un Fonds.

Les types de titres suivants sont exclus du calcul du taux de rotation du portefeuille : fonds d'investissement affiliés, instruments financiers dérivés, Mortgage Dollar Rolls TBA, ventes et rachats dos-à-dos et autres instruments à court terme avec une échéance inférieure à 365 jours.

Le taux de rotation du portefeuille pour l'exercice clos le 31 décembre 2022 de chaque Fonds est le suivant :

Fonds	2022 Taux de rotation du portefeuille
PIMCO Asia High Yield Bond Fund	51 %
Asia Strategic Interest Bond Fund	62 %
PIMCO Capital Securities Fund	35 %
PIMCO Climate Bond Fund	39 %
Commodity Real Return Fund	51 %
PIMCO Credit Opportunities Bond Fund	95 %
Diversified Income Funcj	18 %
Diversified Income Duration Hedged Fund	25 %
Diversified Income ESQ Fund	14 %
Dynamic Bond Fund	56 %
Dynamic Multi-Asset Fund	25 %
Emerging Local Bond Fund	120 %
Emerging Local Bond ESG Fund	37 %
Emerging Markets Bond Fund	50 %
Emerging Markets Bond ESG Fund	26 %
Emerging Markets Corporate Bond Fund	28 %
PIMCO Emerging Markets Opportunities Fund	105 %
Emerging Markets Short-Term Local Currency Fund	55 %
PIMCO ESG Income Fund	86 %
Euro Bond Fund	65 %
Euro Credit Fund	44 %
Euro Income Bond Fund	36 %
Euro Long Average Duration Fund	84 %
Euro Short-Term Fund	97 %
PIMCO European High Yield Bond Fund	47 %
PIMCO European Short-Term Opportunities Fund	59 %
Global Advantage Fund	93 %
Global Bond Fund	118 %
Global Bond ESG Fund	108 %
Global Bond Ex-US Fund	102 %
PIMCO Global Core Asset Allocation Fund	226 %
Global High Yield Bond Fund	14 %
Global Investment Grade Credit Fund	41 %
Global Investment Grade Credit ESG Fund	48 %
Global Low Duration Real Return Fund	49 %
Global Real Return Fund	64 %
Income Fund	143 %
Income Fund II	64 %
Inflation Multi-Asset Fund	196 %
Low Average Duration Fund	68 %
Low Duration Global Investment Grade Credit Fund	21 %
Low Duration Income Fund	122 %
Low Duration Opportunities Fund	33 %
Low Duration Opportunities ESG Fund	16 %
PIMCO MLP & Energy Infrastructure Fund	62 %
Mortgage Opportunities Fund	477 %
StocksPLUS™ Fund	36 %
PIMCO StocksPLUS™ AR Fund	14 %
Strategic Income Fund	119 %
Total Return Bond Fund	164 %
PIMCO TRENDS Managed Futures Strategy Fund	286 %
UK Corporate Bond Fund	41 %
UK Long Term Corporate Bond Fund	39 %
US High Yield Bond Fund	16 %
US Investment Grade Corporate Bond Fund	60 %
US Short-Term Fund	74 %

Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers et du Règlement sur la taxonomie

(non auditées)

Toutes les données présentées dans les annexes suivantes ont été calculées sur la base des titres en portefeuille du Fonds concerné au 31 décembre 2022 et constituent des informations non auditées qui n'ont pas fait l'objet d'une quelconque assurance fournie par les Auditeurs ou par un tiers. Toutes les données et autres informations contenues dans les annexes ont été compilées conformément au cadre interne de finance durable mis en œuvre par le Gestionnaire et le Conseiller en investissement pour le Fonds concerné.

Les Fonds Global Bond ESG Fund, Emerging Markets Bond ESG Fund, Global Investment Grade Credit ESG Fund et PIMCO ESG Income Fund sont classés conformément à l'article 8 du Règlement sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers depuis le 13 juin 2022.

Les fonds Euro Short Term Fund, Global Real Return Fund et Global Low Duration Real Return Fund sont classés en vertu de l'article 8 du Règlement sur les divulgations en matière de finance durable depuis le 22 juillet 2022.

Règlement européen sur la taxonomie

Pour les Fonds classés conformément à l'article 8 ou à l'article 9 du SFDR, veuillez vous reporter à l'Annexe de chaque Fonds, ci-joint, afin d'obtenir des informations relatives à l'alignement avec le Règlement UE/2020/852, c'est-à-dire le Règlement européen sur la taxonomie. Pour les Fonds qui ne sont pas classés conformément à l'article 8 (c.-à-d. ne promouvant pas les caractéristiques environnementales et/ou sociales) ou à l'article 9 (c'est-à-dire qui n'ont pas d'objectif d'investissement durable) en vertu du SFDR, les investissements sous-jacents ne tiennent pas compte des critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 *bis*, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Fonds PIMCO Capital Securities Fund **Identifiant d'entité juridique** : 549300L0UVRKJJGJKO09

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable,** on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental.** Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ **Oui**	☑ **Non**
☐ **Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ %**	☐ **Il promouvait des caractéristiques environnementales/sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables**
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ **Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %**	☑ **Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds a promu les caractéristiques environnementales en comparant tous les investissements directs à la politique d'exclusion du Fonds. Le Fonds a également promu des caractéristiques environnementales en s'engageant activement auprès des émetteurs sur les questions importantes liées au climat, qui ont inclus le fait d'encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les incidences du Fonds sur la durabilité ont été mesurées par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement auprès des émetteurs, ainsi que de sa stratégie d'exclusion. La stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds s'appliquent à 100 % de ses investissements directs.

Par exemple, le processus de présélection du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans le charbon et le pétrole non conventionnel (comme le pétrole arctique et les sables bitumineux). En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes acceptées à l'échelle mondiale telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies, le cas échéant.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir au 31 décembre 2022

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Stichting AK Rabobank Certificaten	Investment Grade Credit	4,69 %	Pays-Bas
Bons du Trésor américain 4,255 % échéance 23/02/2023	Autres instruments nets à duration courte	3,64 %	États-Unis
Bons du Trésor américain 4,279 % échéance 03/09/2023	Autres instruments nets à duration courte	3,51 %	États-Unis
ING Groep NV 5,750 % échéance 16/11/2026	Investment Grade Credit	2,00 %	Pays-Bas
Erste Group Bank AG 4,250 % échéance 15/10/2027	Investment Grade Credit	1,66 %	Autriche
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria S.A. 6,000 % échéance 29/03/2024	Crédit à haut rendement	1,66 %	Espagne
Nationwide Building Society	Investment Grade Credit	1,57 %	Royaume-Uni
Intesa Sanpaolo SpA 7,750 % échéance 11/01/2027	Crédit à haut rendement	1,55 %	Italie
CaixaBank S.A. 6,750 % échéance 13/06/2024	Crédit à haut rendement	1,45 %	Espagne
HSBC Bank Capital Funding Sterling LP 5,844 % échéance 05/11/2031	Investment Grade Credit	1,43 %	Jersey, îles Anglo-Normandes
Bank of Ireland Group PLC 7,500 % échéance 19/05/2025	Crédit à haut rendement	1,39 %	Irlande
HSBC Holdings PLC 4,750 % échéance 04/07/2029	Investment Grade Credit	1,33 %	Royaume-Uni
KBC Group NV 4,250 % échéance 24/10/2025	Investment Grade Credit	1,18 %	Belgique
Credit Suisse Group AG 9,750 % échéance 23/06/2027	Crédit à haut rendement	1,15 %	Suisse
Société Générale S.A. 6,221 % échéance 15/06/2033	Investment Grade Credit	1,15 %	France

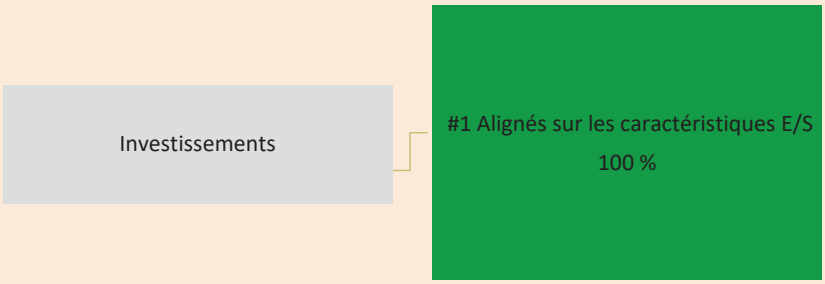
Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la proportion du Fonds qui a promu les caractéristiques environnementales/sociales au 31 décembre 2022 sont fournies ci-dessous.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 décembre 2022, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant les caractéristiques environnementales, car la stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds ont été appliqués à tous ses investissements directs. Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
Investment Grade Credit	59,01 %
Crédit à haut rendement	32,81 %
Titres liés à un gouvernement	12,66 %
Marchés émergents	0,90 %
Autres instruments nets à duration courte	-5,38 %

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les participations du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisées.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Au 31 décembre 2022, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie européenne est de 0 %. Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un auditeur et n'a pas été examiné par un tiers.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE[1] ?

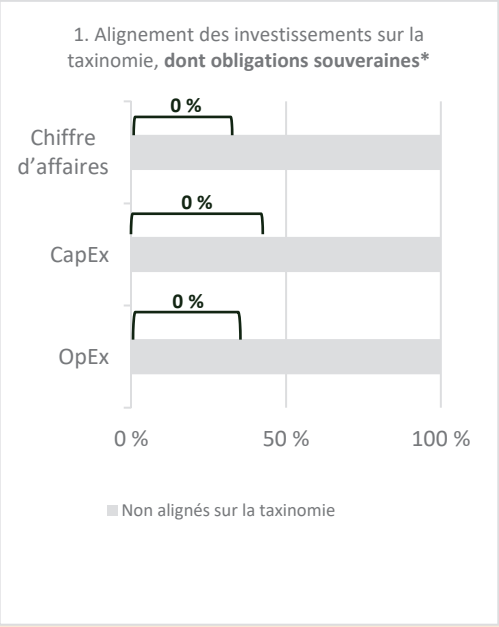
☐ **Oui :**

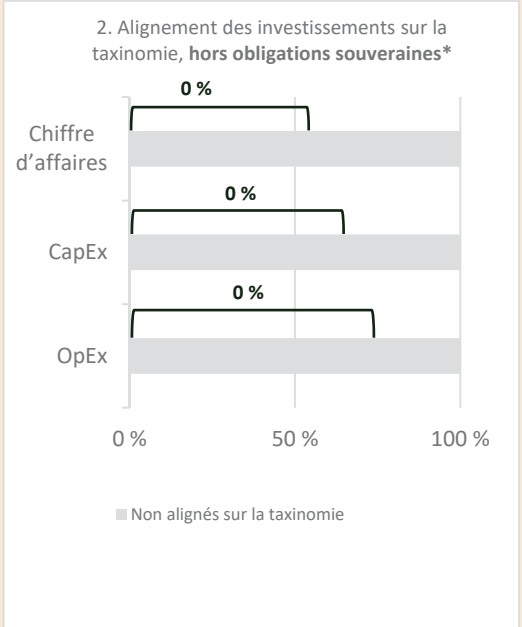
☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

☑ **Non**

[1] Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autre que les obligations souveraines.





****Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines***

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 %.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2022, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant les caractéristiques environnementales, car la stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds ont été appliqués à tous ses investissements directs.

Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé auprès des sociétés et des émetteurs sur des questions importantes liées au climat et a cherché à encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

ANNEXE V

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 9, paragraphes 1 à 4 *bis*, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 5, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Fonds PIMCO Climate Bond Fund **Identifiant d'entité juridique :** 549300KBV832SKE8DW37

Objectif d'investissement durable

Par **investissement durable,** on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental.** Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☑ **Oui**

☑ **Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : 81 %**

- ☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
- ☑ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☑ **Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : 1 % ****

** Bien que le Fonds ait investi dans des investissements durables ayant un objectif social au cours de la période couverte par le présent rapport, il n'a pris aucun engagement à investir dans cette catégorie d'investissements ; par conséquent, ces investissements acquis par le Fonds doivent être considérés comme accessoires par nature.

☐ **Non**

☐ **Il promouvait des caractéristiques environnementales/sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables**

- ☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
- ☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
- ☐ ayant un objectif social

☐ **Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure l'objectif d'investissement durable de ce produit financier a-t-il été atteint ?

Durant la période couverte, le Fonds a visé des rendements ajustés au risque optimaux, en appliquant une gestion prudente des investissements, tout en tenant compte des risques et des opportunités à long terme liés au climat.

Comme indiqué plus en détail ci-dessous, dans la section « Allocation des actif », le Fonds a investi dans des investissements durables composés de Titres ESG à revenu fixe (tels que décrits plus en détail dans la section du Prospectus intitulée **« Titres ESG à revenu fixe »**) qui permettent aux émetteurs de lever des capitaux pour financer des projets présentant des avantages pour l'environnement et qui ont contribué aux objectifs environnementaux d'adaptation au changement climatique et d'atténuation du changement climatique.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les objectifs de durabilité de ce produit financier sont atteints.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les incidences du Fonds sur la durabilité sont mesurées par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement envers les émetteurs, de sa stratégie d'exclusion et de son investissement dans des Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée **« Titres ESG à revenu fixe »**).

Par exemple, le processus de présélection du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans les secteurs liés aux combustibles fossiles. En outre, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Dans quelle mesure les investissements durables n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ?

Les investissements durables du Fonds ont été évalués afin de s'assurer qu'ils ne causent pas de préjudice important à tout objectif environnemental ou social. Cette évaluation a été réalisée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de divers indicateurs de durabilité défavorables, y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition à des secteurs liés aux combustibles fossiles et les émissions de gaz à effet de serre.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les titres ont été sélectionnés selon le processus de présélection interne du Conseiller en investissement en matière de durabilité. Ce processus de présélection a pris en compte les incidences négatives sur les facteurs de durabilité, notamment l'exposition aux secteurs liés aux combustibles fossiles. Le Conseiller en investissement a cherché à atténuer les principales incidences négatives, notamment par le biais de l'engagement auprès des émetteurs et de la présélection des exclusions.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ?

Description détaillée :

Le Conseiller en investissement s'est assuré que les investissements durables étaient alignés sur les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et sur les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme par le biais d'une présélection des controverses du Pacte mondial des Nations unies ainsi que d'autres instruments, notamment les scores et les recherches ESG, dans le cadre du processus de diligence raisonnable des investissements.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences des décisions d'investissement qui « entraînent des répercussions négatives sur les facteurs de durabilité », les facteurs de durabilité étant définis comme « les questions environnementales, sociales et de personnel, le respect des droits de l'homme, la lutte contre la corruption et les actes de corruption ».

Le Fonds a pris en considération les principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité (y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition à des secteurs liés aux combustibles fossiles et les émissions de gaz à effet de serre) au cours de la période de référence.

Le Conseiller en investissement a visé à prendre en considération les principales incidences négatives dans le cadre du processus d'investissement et a utilisé une combinaison de méthodes pour contribuer à atténuer les principales incidences négatives, notamment par le biais de l'engagement auprès des émetteurs et des exclusions.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir au 31 décembre 2022

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 1,375 % échéance 07/06/2032	Titres liés à un gouvernement	4,88 %	Allemagne
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 2,000 % échéance 15/11/2029	Titres liés à un gouvernement	3,55 %	Allemagne
Banque européenne d'investissement 1,500 % échéance 15/06/2032	Titres liés à un gouvernement	1,78 %	Supranationales
Obligation internationale du gouvernement canadien 2,250 % échéance 01/12/2029	Titres liés à un gouvernement	1,51 %	Canada
Bon du Trésor britannique 0,875 % échéance 31/07/2033	Titres liés à un gouvernement	1,14 %	Royaume-Uni
Verizon Communications, Inc. 1,500 % échéance 18/09/2030	Investment Grade Credit	1,10 %	États-Unis
Bons du Trésor autrichiens 1,267 % échéance 23/02/2023	Autres instruments nets à duration courte	0,98 %	Autriche
NTT Finance Corp. 4,239 % échéance 25/07/2025	Investment Grade Credit	0,97 %	Japon
BNP Paribas S.A. 0,500 % échéance 04/06/2026	Investment Grade Credit	0,97 %	France
ABN AMRO Bank NV 2,470 % échéance 13/12/2029	Investment Grade Credit	0,94 %	Pays-Bas
UniCredit SpA 5,850 % échéance 15/11/2027	Investment Grade Credit	0,82 %	Italie

HAT Holdings LLC 3,750 % échéance 15/09/2030	Crédit à haut rendement	0,81 %	États-Unis
Compass Group PLC 4,375 % échéance 08/09/2032	Investment Grade Credit	0,75 %	Royaume-Uni
India Green Energy Holdings 5,375 % échéance 29/04/2024	Marché émergent extérieur	0,69 %	Île Maurice
ING Groep NV 4,875 % échéance 16/05/2029	Crédit à haut rendement	0,69 %	Pays-Bas

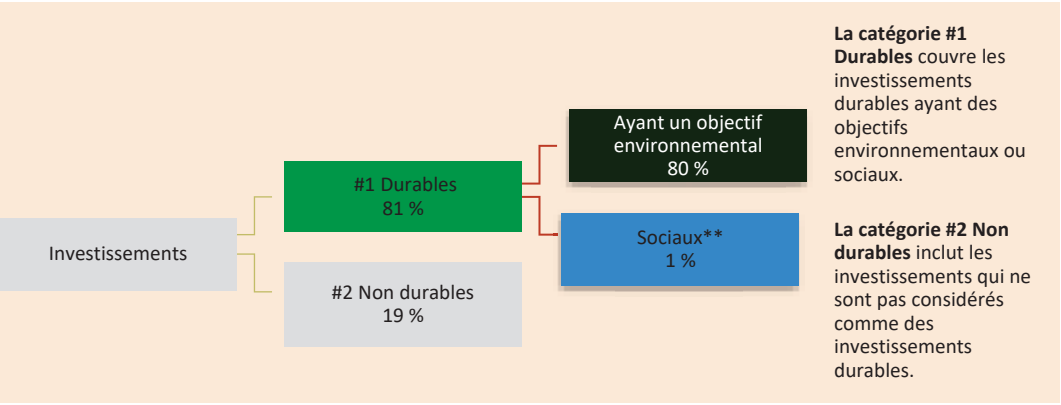
Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la proportion d'investissements durables du Fonds au 31 décembre 2022 sont fournies ci-dessous.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?



Au 31 décembre 2022, le Fonds était entièrement composé d'investissements durables, à l'exception des investissements détenus à d'autres fins, telles que des fins de liquidité ou de couverture.

À cette date, le Fonds a investi 81 % de son actif net dans des investissements durables. 80 % de l'actif net ont été investis dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif environnemental.

** Le Fonds a également investi 1 % de son actif net dans des investissements durables contribuant à un objectif social. Il convient de noter que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social et que ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

Le Fonds a investi 19 % de son actif net dans des investissements du Fonds ne constituant pas des « investissements durables » ; ils ont été utilisés à des fins de gestion globale des risques, notamment à des fins de liquidité ou de couverture.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
Investment Grade Credit	46,06 %
Titres liés à un gouvernement	34,80 %
Crédit à haut rendement	8,19 %
Marché émergent extérieur	5,19 %
Autres instruments nets à duration courte	4,09 %
Titrisé	1,35 %
Municipaux	0,25 %
Obligations couvertes et Pfandbriefe	0,07 %

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Au 31 décembre 2022, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie européenne est de 0 %. Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un auditeur et n'a pas été examiné par un tiers.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE[1] ?

☐ **Oui :**

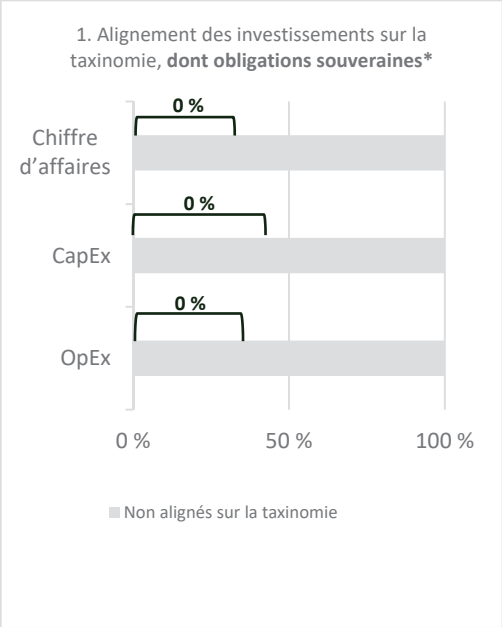
☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

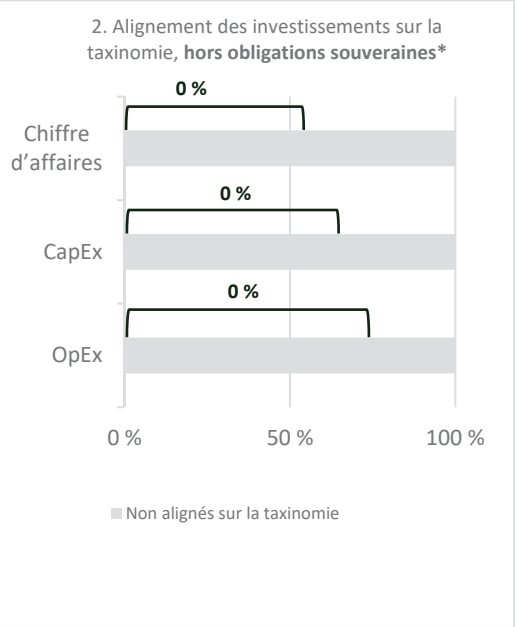
☑ **Non**

[1] Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autre que les obligations souveraines.





****Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines***

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 %.

Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental **qui ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

Quelle était la proportion minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE, mais s'engage à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif environnemental. Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements durables du Fonds qui ont contribué à un objectif environnemental sans être évalués par rapport à la taxinomie de l'UE et qui, par conséquent, étaient classés dans la catégorie « Environnementaux autres » ci-dessus est de 80 %. Pour de plus amples informations concernant la disponibilité des données relatives à la durabilité et les défis associés, veuillez consulter le site https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland.

Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2022, 1 % des investissements du Fonds étaient des investissements durables contribuant à un objectif social au cours de la période couverte par les états financiers. Étant donné que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des

investissements durables qui contribuent à un objectif social, ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

Quels investissements sont inclus dans la catégorie « Non durables Autres », quelle est leur finalité et existe-t-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2022, le Fonds était entièrement composé d'investissements durables, à l'exception des investissements détenus à d'autres fins, telles que des fins de liquidité ou de couverture. Comme décrit plus en détail ci-dessus, à cette date, le Fonds avait investi 81 % de son actif net du Fonds dans des investissements durables.

La proportion d'investissements du Fonds qui ne constituaient pas des « investissements durables » a été utilisée à des fins de gestion globale des risques, notamment à des fins de liquidité ou de couverture. Les émetteurs et les instruments financiers dérivés utilisés pour atteindre ces objectifs ont été soumis à des présélections basées sur des critères ESG qui visent à garantir le respect de garanties environnementales et/ou sociales minimales pertinentes.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre l'objectif d'investissement durable au cours de la période de référence ?

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé auprès des sociétés et des émetteurs sur des questions importantes liées au climat et a cherché à encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 *bis*, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Fonds Diversified Income ESG Fund **Identifiant d'entité juridique :** 549300ECS7VMY4LHDC04

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ **Oui**	☑ **Non**
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ %**	☑ Il **promouvait des caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 47 % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☑ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☑ ayant un objectif social**
	** Bien que le Fonds ait investi dans des investissements durables ayant un objectif social au cours de la période couverte par le présent rapport, il n'a pris aucun engagement à investir dans cette catégorie d'investissements ; par conséquent, ces investissements acquis par le Fonds doivent être considérés comme accessoires par nature.
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social : ___ %**	☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Par **investissement durable,** on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

L'approche du Fonds en matière d'investissement durable passe par la promotion de caractéristiques environnementales et sociales (bien que le Fonds n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables).

Comme indiqué ci-dessous, les investissements durables détenus par le Fonds au cours de la période de référence ont contribué aux objectifs environnementaux d'adaptation au changement climatique et d'atténuation du changement climatique.

Les instruments dérivés détenus par le Fonds au cours de la période ont été contrôlés par rapport à la politique d'exclusion mise en œuvre par le Conseiller en investissement et ont donc été utilisés pour promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Les incidences du Fonds sur la durabilité ont été mesurées par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement envers les émetteurs, de sa stratégie d'exclusion et de son investissement dans certains Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée **« Titres ESG à revenu fixe »**) qui permettent aux émetteurs de lever des capitaux pour financer des projets présentant des avantages pour l'environnement, ainsi que dans des titres de créance d'émetteurs ayant exercé un leadership dans la gestion des risques et des opportunités liés au changement climatique.

Par exemple, le processus de présélection du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans le charbon et le pétrole. En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, le cas échéant.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Les investissements durables sous-jacents du Fonds ont principalement contribué aux objectifs environnementaux d'atténuation du changement climatique et d'adaptation au changement climatique au cours de la période de référence, et ce, de diverses manières, y compris, à titre d'exemple, l'investissement dans des Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée **« Titres ESG à revenu fixe »**), dont les obligations vertes.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Les investissements durables du Fonds ont été évalués afin de s'assurer qu'ils ne causent pas de préjudice important à tout objectif environnemental ou social. Cette évaluation a été réalisée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de divers indicateurs de durabilité défavorables, y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition au charbon et au pétrole et les émissions de gaz à effet de serre.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les titres ont été sélectionnés selon le processus de présélection interne du Conseiller en investissement en matière de durabilité. Ce processus de

présélection comprend la prise en compte des incidences négatives sur les facteurs de durabilité, notamment l'exposition au secteur du charbon et du pétrole, ainsi qu'aux armes controversées. Le Conseiller en investissement a cherché à atténuer les principales incidences négatives, notamment par le biais de l'engagement auprès des émetteurs et de la présélection des exclusions.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le Conseiller en investissement s'est assuré que les investissements durables étaient alignés sur les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et sur les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme par le biais d'une présélection des controverses du Pacte mondial des Nations unies ainsi que d'autres instruments, notamment les scores et les recherches ESG, dans le cadre du processus de diligence raisonnable des investissements.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences des décisions d'investissement qui « entraînent des répercussions négatives sur les facteurs de durabilité », les facteurs de durabilité étant définis comme « les questions environnementales, sociales et de personnel, le respect des droits de l'homme, la lutte contre la corruption et les actes de corruption ».

Le Fonds a pris en considération les principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité (y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition au charbon et au pétrole, les émissions de gaz à effet de serre et l'exposition aux armes controversées) au cours de la période de référence.

Le Conseiller en investissement a visé à prendre en considération les principales incidences négatives dans le cadre du processus d'investissement et a utilisé une combinaison de méthodes pour contribuer à atténuer les principales incidences négatives, y compris l'engagement auprès des émetteurs et les exclusions.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir au 31 décembre 2022

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Bons du Trésor américain 4,290 % échéance 09/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	14,10 %	États-Unis
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	Titrisé	2,04 %	États-Unis
Bons du Trésor américain 4,397 % échéance 23/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	2,01 %	États-Unis
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/02/2053	Titrisé	2,00 %	États-Unis
ReNew Power Pvt Ltd. 5,875 % échéance 05/03/2027	Marché émergent extérieur	1,95 %	Inde
Obligation internationale du gouvernement omanais 6,750 % échéance 17/01/2048	Marché émergent extérieur	1,91 %	Oman
Banco BTG Pactual S.A. 2,750 % échéance 11/01/2026	Marché émergent extérieur	1,85 %	Brésil
HSBC Holdings PLC 3,973 % échéance 22/05/2030	Investment Grade Credit	1,78 %	Royaume-Uni
BNP Paribas S.A. 1,675 % échéance 30/06/2027	Investment Grade Credit	1,77 %	France
Obligations du Trésor américain 4,000 % échéance 15/11/2042	Titres liés à un gouvernement	1,74 %	États-Unis
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc. 2,472 % échéance 14/01/2029	Investment Grade Credit	1,71 %	Japon
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 6,500 % échéance 15/02/2048	Marché émergent extérieur	1,68 %	République dominicaine
Natura Cosmeticos S.A. 4,125 % échéance 03/05/2028	Marché émergent extérieur	1,65 %	Brésil
Obligation internationale du gouvernement chilien 3,100 % échéance 07/05/2041	Marché émergent extérieur	1,46 %	Chili
Obligation internationale du gouvernement marocain 4,000 % échéance 15/12/2050	Marché émergent extérieur	1,40 %	Maroc

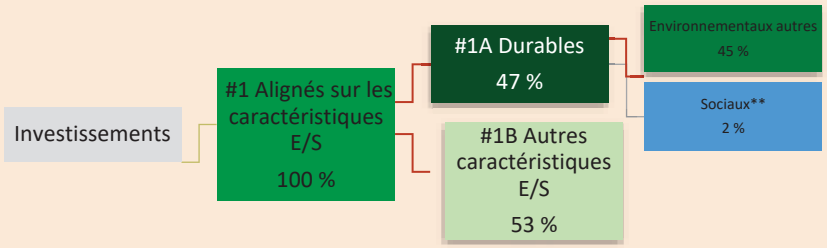
Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la proportion du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales et la proportion du Fonds investie dans des investissements durables au 31 décembre 2022 sont fournies ci-dessous.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **# 1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :
- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Au 31 décembre 2022, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et sociales, car tous les investissements du Fonds ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion.

À cette date, le Fonds a investi 47 % de son actif net dans des investissements durables. 45 % de l'actif net ont été investis dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif environnemental.

**Le Fonds détenait également 2 % de son actif net dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social. Il convient de noter que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social et que ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
Investment Grade Credit	33,21 %
Crédit à haut rendement	24,73 %
Marché émergent extérieur	21,42 %
Autres instruments nets à duration courte	8,64 %
Titres liés à un gouvernement	7,96 %
Titrisé	4,04 %

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Au 31 décembre 2022, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie européenne est de 0 %. Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un auditeur et n'a pas été examiné par un tiers.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE[1] ?

☐ **Oui :**

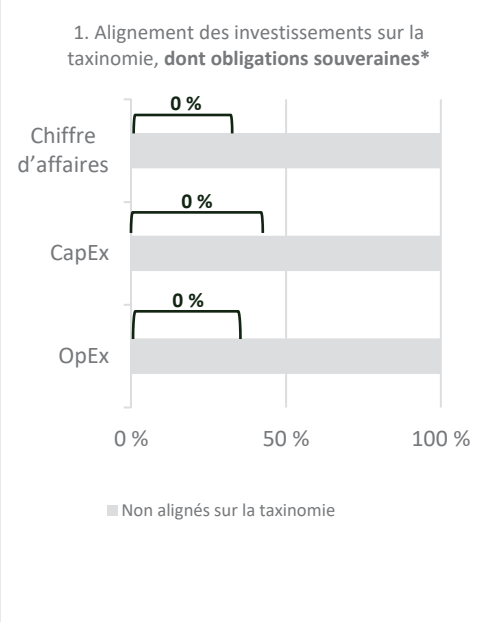
☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

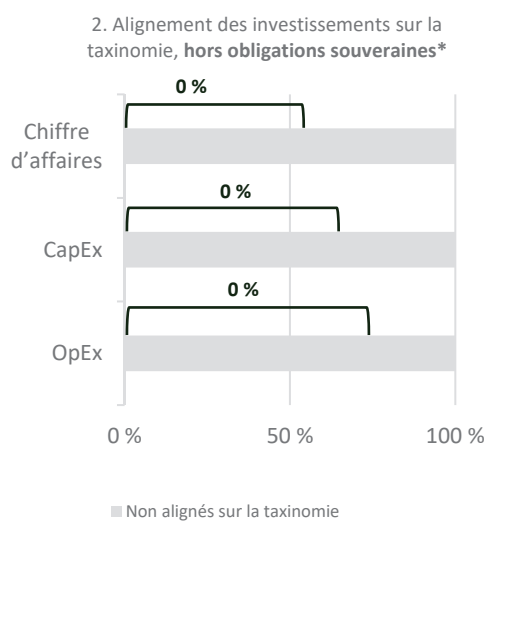
☑ **Non**

[1] Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autre que les obligations souveraines.





**Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines*

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 %.

Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE, mais s'engage à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif environnemental. Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements durables du Fonds qui ont contribué à un objectif environnemental sans être évalués par rapport à la taxinomie de l'UE et qui, par conséquent, étaient classés dans la catégorie « Environnementaux autres » ci-dessus est de 45 %. Pour de plus amples informations concernant la disponibilité des données relatives à la durabilité et les défis associés, veuillez consulter le site https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland.

Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Comme indiqué ci-dessus, le Fonds détenait 2 % de son actif net dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif social au cours de la période couverte par les présents états financiers. Étant donné que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social, ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2022, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et sociales, car tous les investissements du Fonds ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion. Comme indiqué plus en détail ci-dessus, à cette date, le Fonds a investi 47 % de son actif net dans des investissements durables.

Par conséquent, au 31 décembre 2022, aucun investissement au sein du portefeuille était non aligné sur les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé auprès des sociétés et des émetteurs sur des questions importantes liées au climat et a cherché à encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 *bis*, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Fonds Dynamic Multi-Asset Fund **dentifiant d'entité juridique :** 549300ZZOV14P64W6594

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ **Oui**	☑ **Non**
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ %**	☐ Il **promouvait des caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social : ___ %**	☑ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Par **investissement durable,** on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental.** Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds a promu les caractéristiques environnementales en comparant tous les investissements directs à la politique d'exclusion du Fonds. Le Fonds a également promu des caractéristiques environnementales en s'engageant activement auprès des émetteurs sur les questions importantes liées au climat, qui ont inclus le fait d'encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les incidences du Fonds sur la durabilité ont été mesurées par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement auprès des émetteurs, ainsi que de sa stratégie d'exclusion. La stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds s'appliquent à 100 % de ses investissements directs.

Par exemple, le processus de présélection du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans le charbon et le pétrole non conventionnel (comme le pétrole arctique et les sables bitumineux). En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes acceptées à l'échelle mondiale telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies, le cas échéant.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion des investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir au 31 décembre 2022

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	Autres instruments nets à duration courte	6,45 %	Irlande
PIMCO Funds : Global Investors Series plc - Fonds Income Fund	Municipaux	1,98 %	Irlande
Bons du Trésor japonais (0,142) % échéance 06/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	1,80 %	Japon
Bons du Trésor japonais (0,182) % échéance 20/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	1,78 %	Japon
Bons du Trésor japonais (0,131) % échéance 06/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	1,72 %	Japon
Bons du Trésor japonais (0,181) % échéance 13/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	1,54 %	Japon
Bons du Trésor japonais (0,209) % échéance 06/01/2023	Autres instruments nets à duration courte	1,39 %	Japon
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	Autre	1,02 %	États-Unis
Bons du Trésor italien 2,200 % échéance 28/04/2023	Titres liés à un gouvernement	0,96 %	Italie
First Solar, Inc.	Autre	0,94 %	États-Unis
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	Marché émergent local	0,93 %	Taïwan
SolarEdge Technologies, Inc.	Autre	0,90 %	Israël
Humana, Inc.	Autre	0,87 %	États-Unis
Vestas Wind Systems A/S	Autre	0,84 %	Danemark
Elevance Health, Inc.	Autre	0,81 %	États-Unis

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

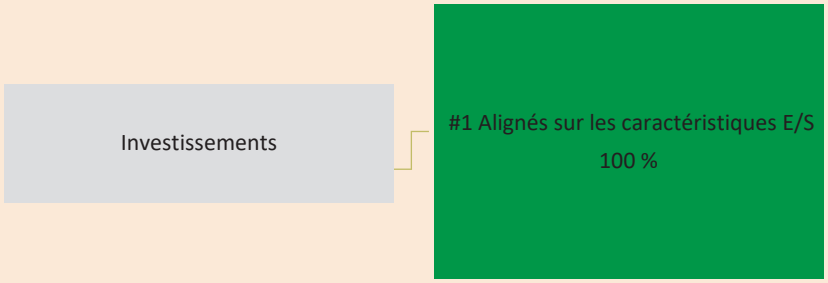
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la proportion du Fonds qui a promu les caractéristiques environnementales/sociales au 31 décembre 2022 sont fournies ci-dessous.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 décembre 2022, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant les caractéristiques environnementales, car la stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds ont été appliqués à tous ses investissements directs. Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
Titres liés à un gouvernement	83,23 %
Autre	32,28 %
Marchés émergents locaux	7,60 %
Crédit à haut rendement	4,23 %
Municipaux	3,38 %
Investment Grade Credit	1,99 %
Titrisé	1,44 %
Marchés émergents extérieurs	0,43 %
Autres instruments nets à duration courte	-34,59 %

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les participations du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisées.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Au 31 décembre 2022, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie européenne est de 0 %. Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un auditeur et n'a pas été examiné par un tiers.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE[1] ?

☐ **Oui :**

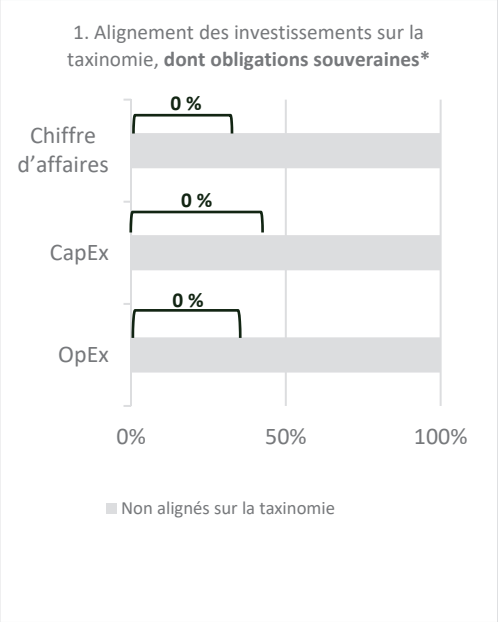
☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

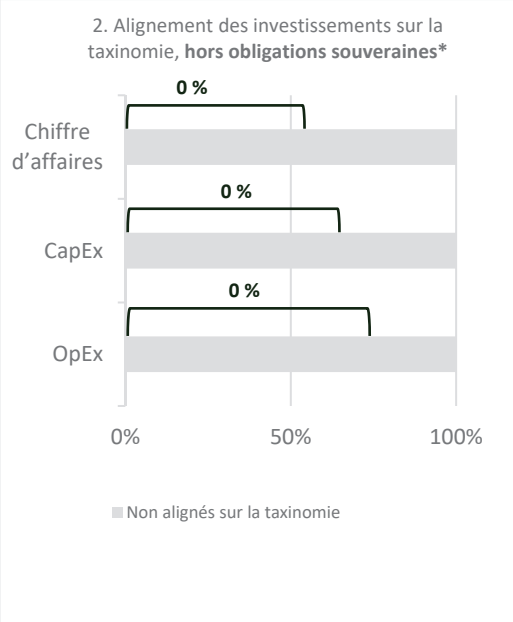
✓ **Non**

[1] Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autre que les obligations souveraines.





Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 %.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2022, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant les caractéristiques environnementales, car la stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds ont été appliqués à tous ses investissements directs.

Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé auprès des sociétés et des émetteurs sur des questions importantes liées au climat et a cherché à encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 *bis*, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Fonds Emerging Local Bond ESG Fund **Identifiant d'entité juridique :** 549300XJ4S7ZD2HUGI18

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable,** on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ Oui	☑ Non
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental :** ___ %	☑ Il **promouvait des caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 27 % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☑ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☑ ayant un objectif social**
	** Bien que le Fonds ait investi dans des investissements durables ayant un objectif social au cours de la période couverte par le présent rapport, il n'a pris aucun engagement à investir dans cette catégorie d'investissements ; par conséquent, ces investissements acquis par le Fonds doivent être considérés comme accessoires par nature.
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social :** ___ %	☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

L'approche du Fonds en matière d'investissement durable passe par la promotion de caractéristiques environnementales et sociales (bien que le Fonds n'ait pas pour objectif

l'investissement durable, il cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables).

Comme indiqué ci-dessous, les investissements durables détenus par le Fonds au cours de la période de référence ont contribué aux objectifs environnementaux d'adaptation au changement climatique et d'atténuation du changement climatique.

Les instruments dérivés détenus par le Fonds au cours de la période ont été contrôlés par rapport à la politique d'exclusion mise en œuvre par le Conseiller en investissement et ont donc été utilisés pour promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Les incidences du Fonds sur la durabilité ont été mesurées par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement envers les émetteurs, de sa stratégie d'exclusion et de son investissement dans certains Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée **« Titres ESG à revenu fixe »**) qui permettent aux émetteurs de lever des capitaux pour financer des projets présentant des avantages pour l'environnement, ainsi que dans des titres de créance d'émetteurs ayant exercé un leadership dans la gestion des risques et des opportunités liés au changement climatique.

Par exemple, le processus de présélection du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans le charbon et le pétrole. En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, le cas échéant.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Les investissements durables sous-jacents du Fonds ont principalement contribué aux objectifs environnementaux d'atténuation du changement climatique et d'adaptation au changement climatique au cours de la période de référence, et ce, de diverses manières, y compris, à titre d'exemple, l'investissement dans des Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée **« Titres ESG à revenu fixe »**), dont les obligations vertes.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les investissements durables du Fonds ont été évalués afin de s'assurer qu'ils ne causent pas de préjudice important à tout objectif environnemental ou social. Cette évaluation a été réalisée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de divers indicateurs de durabilité défavorables, y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition au charbon et au pétrole et les émissions de gaz à effet de serre.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les titres ont été sélectionnés selon le processus de présélection interne du Conseiller en investissement en matière de durabilité. Ce processus de présélection comprend la prise en compte des incidences négatives sur les facteurs de durabilité, notamment l'exposition au secteur du charbon et du pétrole, ainsi qu'aux armes controversées. Le Conseiller en investissement a cherché à atténuer les principales incidences négatives, notamment par le biais de l'engagement auprès des émetteurs et de la présélection des exclusions.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Le Conseiller en investissement s'est assuré que les investissements durables étaient alignés sur les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et sur les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme par le biais d'une présélection des controverses du Pacte mondial des Nations unies ainsi que d'autres instruments, notamment les scores et les recherches ESG, dans le cadre du processus de diligence raisonnable des investissements.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences des décisions d'investissement qui « entraînent des répercussions négatives sur les facteurs de durabilité », les facteurs de durabilité étant définis comme « les questions environnementales, sociales et de personnel, le respect des droits de l'homme, la lutte contre la corruption et les actes de corruption ».

Le Fonds a pris en considération les principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité (y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition au charbon et au pétrole, les émissions de gaz à effet de serre et l'exposition aux armes controversées) au cours de la période de référence.

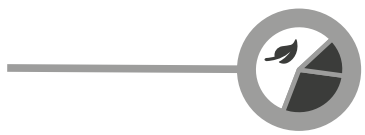
Le Conseiller en investissement a visé à prendre en considération les principales incidences négatives dans le cadre du processus d'investissement et a utilisé une combinaison de méthodes pour contribuer à atténuer les principales incidences négatives, y compris l'engagement auprès des émetteurs et les exclusions.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir au 31 décembre 2022

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Bons du Trésor américain 4,397 % échéance 23/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	5,99 %	États-Unis
TES colombien 7,000 % échéance 26/03/2031	Marchés émergents	3,54 %	Colombie
Obligation internationale du Gouvernement de République tchèque 2,400 % échéance 17/09/2025	Titres liés à un gouvernement	2,98 %	République tchèque
Émission d'investissement du Gouvernement malaisien 4,130 % échéance 09/07/2029	Marchés émergents	2,94 %	Malaisie
Obligation internationale du Gouvernement sud-africain 10,500 % échéance 21/12/2026	Marchés émergents	2,73 %	Afrique du Sud
Obligation internationale du Gouvernement sud-africain 8,750 % échéance 28/02/2048	Marchés émergents	2,71 %	Afrique du Sud
International Bank for Reconstruction & Development 4,750 % échéance 21/01/2027	Titres liés à un gouvernement	2,63 %	Supranationales
Obligation internationale du Gouvernement roumain 3,250 % échéance 29/04/2024	Marchés émergents	2,50 %	Roumanie
Obligation internationale du Gouvernement mexicain 7,500 % échéance 03/06/2027	Marchés émergents	2,48 %	Mexique
Bons du Trésor hongrois 18,250 % échéance 03/01/2023	Autres instruments nets à duration courte	2,26 %	Hongrie
Bons du Trésor israéliens 0,529 % échéance 08/02/2023	Autres instruments nets à duration courte	2,14 %	Israël
Émission d'investissement du Gouvernement malaisien 4,369 % échéance 31/10/2028	Marchés émergents	2,14 %	Malaisie
Obligation internationale du Gouvernement israélien 0,150 % échéance 31/07/2023	Marchés émergents	2,10 %	Israël
Banque interaméricaine de développement 5,500 % échéance 07/02/2023	Autres instruments nets à duration courte	2,06 %	Supranationales
International Bank for Reconstruction & Development 9,750 % échéance 21/01/2027	Titres liés à un gouvernement	2,04 %	Supranationales

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

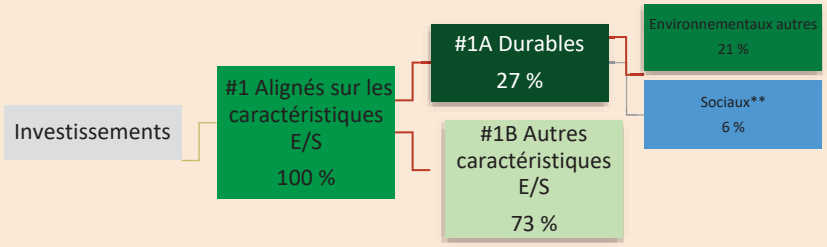


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la proportion du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales et la proportion du Fonds investie dans des investissements durables au 31 décembre 2022 sont fournies ci-dessous.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **# 1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :
- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Au 31 décembre 2022, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et sociales, car tous les investissements du Fonds ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion.

À cette date, le Fonds a investi 27 % de son actif net dans des investissements durables. 21 % de l'actif net ont été investis dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif environnemental.

**Le Fonds détenait également 6 % de son actif net dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social. Il convient de noter que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social et que ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
Marchés émergents	70,50 %
Titres liés à un gouvernement	24,33 %
Autres instruments nets à duration courte	5,17 %

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Au 31 décembre 2022, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie européenne est de 0 %. Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un auditeur et n'a pas été examiné par un tiers.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE[1] ?

☐ **Oui :**

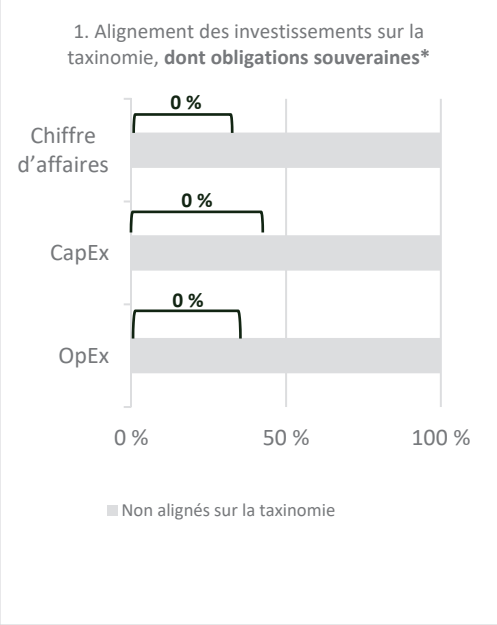
☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

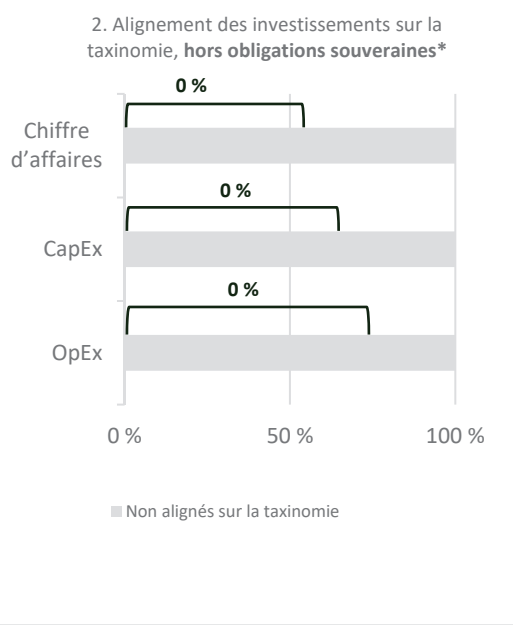
☑ **Non**

[1] Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autre que les obligations souveraines.





**Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines*

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 %.

Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020 /852.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE, mais s'engage à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif environnemental. Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements durables du Fonds qui ont contribué à un objectif environnemental sans être évalués par rapport à la taxinomie de l'UE et qui, par conséquent, étaient classés dans la catégorie « Environnementaux autres » ci-dessus est de 21 %. Pour de plus amples informations concernant la disponibilité des données relatives à la durabilité et les défis associés, veuillez consulter le site https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland.

Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Comme indiqué ci-dessus, le Fonds détenait 6 % de son actif net dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif social au cours de la période couverte par les présents états financiers. Étant donné que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social, ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2022, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et sociales, car tous les investissements du Fonds ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion. Comme indiqué plus en détail ci-dessus, à cette date, le Fonds a investi 27 % de son actif net dans des investissements durables.

Par conséquent, au 31 décembre 2022, aucun investissement au sein du portefeuille était non aligné sur les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé auprès des sociétés et des émetteurs sur des questions importantes liées au climat et a cherché à encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 *bis*, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Fonds Emerging Markets Bond ESG Fund **Identifiant d'entité juridique :** IU161HZ5QHJ5X3UAQ421

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable,** on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ **Oui**	☑ **Non**
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental :** ___ %	☑ Il **promouvait des caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 25 % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☑ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☑ ayant un objectif social**
	** Bien que le Fonds ait investi dans des investissements durables ayant un objectif social au cours de la période couverte par le présent rapport, il n'a pris aucun engagement à investir dans cette catégorie d'investissements ; par conséquent, ces investissements acquis par le Fonds doivent être considérés comme accessoires par nature.
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social :** ___ %	☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

L'approche du Fonds en matière d'investissement durable passe par la promotion de caractéristiques environnementales et sociales (bien que le Fonds n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables).

Comme indiqué ci-dessous, les investissements durables détenus par le Fonds au cours de la période de référence ont contribué aux objectifs environnementaux d'adaptation au changement climatique et d'atténuation du changement climatique.

Les instruments dérivés détenus par le Fonds au cours de la période ont été contrôlés par rapport à la politique d'exclusion mise en œuvre par le Conseiller en investissement et ont donc été utilisés pour promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les incidences du Fonds sur la durabilité ont été mesurées par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement envers les émetteurs, de sa stratégie d'exclusion et de son investissement dans certains Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée **« Titres ESG à revenu fixe »**) qui permettent aux émetteurs de lever des capitaux pour financer des projets présentant des avantages pour l'environnement, ainsi que dans des titres de créance d'émetteurs ayant exercé un leadership dans la gestion des risques et des opportunités liés au changement climatique.

Par exemple, le processus de présélection du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans le charbon et le pétrole. En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, le cas échéant.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Les investissements durables sous-jacents du Fonds ont principalement contribué aux objectifs environnementaux d'atténuation du changement climatique et d'adaptation au changement climatique au cours de la période de référence, et ce, de diverses manières, y compris, à titre d'exemple, l'investissement dans des Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée **« Titres ESG à revenu fixe »**), dont les obligations vertes.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les investissements durables du Fonds ont été évalués afin de s'assurer qu'ils ne causent pas de préjudice important à tout objectif environnemental ou social. Cette évaluation a été réalisée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de divers indicateurs de durabilité défavorables, y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition au charbon et au pétrole et les émissions de gaz à effet de serre.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les titres ont été sélectionnés selon le processus de présélection interne du Conseiller en investissement en matière de durabilité. Ce processus de présélection comprend la prise en compte des incidences négatives sur les facteurs de durabilité, notamment l'exposition au secteur du charbon et du pétrole, ainsi qu'aux armes controversées. Le Conseiller en investissement a cherché à atténuer les principales incidences négatives, notamment par le biais de l'engagement auprès des émetteurs et de la présélection des exclusions.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le Conseiller en investissement s'est assuré que les investissements durables étaient alignés sur les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et sur les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme par le biais d'une présélection des controverses du Pacte mondial des Nations unies ainsi que d'autres instruments, notamment les scores et les recherches ESG, dans le cadre du processus de diligence raisonnable des investissements.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences des décisions d'investissement qui « entraînent des répercussions négatives sur les facteurs de durabilité », les facteurs de durabilité étant définis comme « les questions environnementales, sociales et de personnel, le respect des droits de l'homme, la lutte contre la corruption et les actes de corruption ».

Le Fonds a pris en considération les principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité (y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition au charbon et au pétrole, les émissions de gaz à effet de serre et l'exposition aux armes controversées) au cours de la période de référence.

Le Conseiller en investissement a visé à prendre en considération les principales incidences négatives dans le cadre du processus d'investissement et a utilisé une combinaison de méthodes pour contribuer à atténuer les principales incidences négatives, y compris l'engagement auprès des émetteurs et les exclusions.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir au 31 décembre 2022

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Obligations du Trésor américain 3,250 % échéance 15/05/2042	Titres liés à un gouvernement	2,34 %	États-Unis
Billets du Trésor américain 3,125 % échéance 31/08/2029	Titres liés à un gouvernement	1,44 %	États-Unis
Bons du Trésor israéliens 0,531 % échéance 08/02/2023	Autres instruments nets à duration courte	1,34 %	Israël
Obligation internationale du gouvernement argentin 3,500 % échéance 09/07/2041	Marchés émergents	1,26 %	Argentine
Obligation internationale du gouvernement d'Équateur 2,500 % échéance 31/07/2035	Marchés émergents	1,20 %	Équateur
Obligation internationale du gouvernement de République dominicaine 5,875 % échéance 30/01/2060	Marchés émergents	1,12 %	République dominicaine
Obligation internationale du Gouvernement israélien 1,500 % échéance 30/11/2023	Marchés émergents	1,00 %	Israël
Obligation internationale du Gouvernement roumain 2,124 % échéance 16/07/2031	Marchés émergents	0,94 %	Roumanie
Obligations du Trésor américain 3,375 % échéance 15/08/2042	Titres liés à un gouvernement	0,92 %	États-Unis
Obligation internationale du Gouvernement israélien 0,150 % échéance 31/07/2023	Marchés émergents	0,89 %	Israël
Bons du Trésor israéliens 1,837 % échéance 02/08/2023	Autres instruments nets à duration courte	0,86 %	Israël
Obligation internationale du gouvernement de Côte d'Ivoire 5,250 % échéance 22/03/2030	Marchés émergents	0,72 %	Côte d'Ivoire
Obligation internationale du gouvernement kazakh 6,500 % échéance 21/07/2045	Marchés émergents	0,68 %	Kazakhstan
Obligation internationale du gouvernement turc 5,750 % échéance 11/05/2047	Marchés émergents	0,68 %	Turquie
Bons du Trésor israéliens 1,755 % échéance 05/07/2023	Autres instruments nets à duration courte	0,67 %	Israël

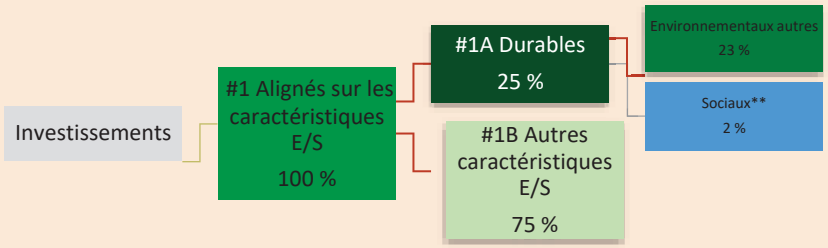
Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la proportion du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales et la proportion du Fonds investie dans des investissements durables au 31 décembre 2022 sont fournies ci-dessous.

Quelle était l'allocation des actifs ?

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **# 1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :
- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Au 31 décembre 2022, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et sociales, car tous les investissements du Fonds ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion.

À cette date, le Fonds a investi 25 % de son actif net dans des investissements durables. 23 % de l'actif net ont été investis dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif environnemental.

**Le Fonds détenait également 2 % de son actif net dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social. Il convient de noter que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social et que ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
Marchés émergents	65,23 %
Titres liés au gouvernement américain	18,38 %
Autre	11,84 %
Investment Grade Credit	9,76 %
Titrisé	0,44 %
Crédit à haut rendement	0,44 %
Autres instruments nets à duration courte	-1,73 %
Pays développés hors USD	-4,37 %

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Au 31 décembre 2022, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie européenne est de 0 %. Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un auditeur et n'a pas été examiné par un tiers.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE[1] ?

☐ **Oui :**

☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

☑ **Non**

[1] Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

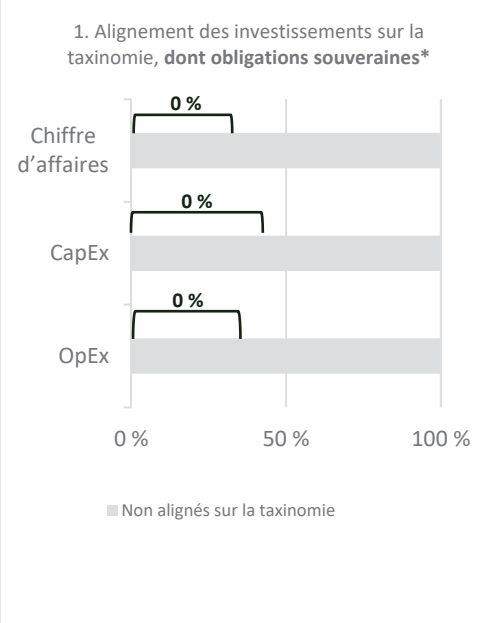
Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

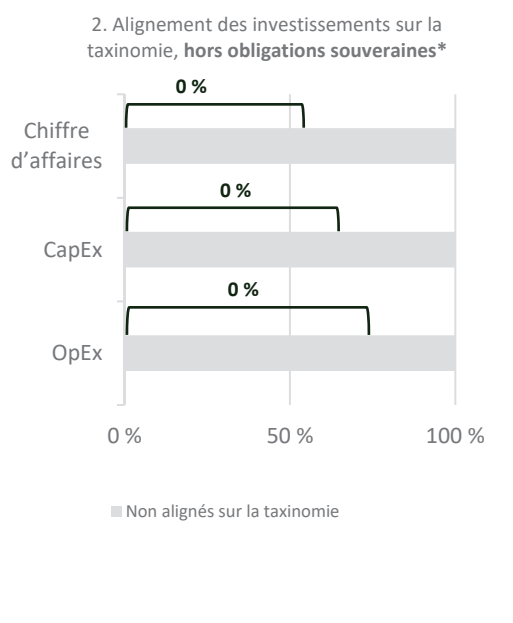
Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autre que les obligations souveraines.





Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 %.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

Le Fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE, mais s'engage à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif environnemental. Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements durables du Fonds qui ont contribué à un objectif environnemental sans être évalués par rapport à la taxinomie de l'UE et qui, par conséquent, étaient classés dans la catégorie « Environnementaux autres » ci-dessus est de 23 %. Pour de plus amples informations concernant la disponibilité des données relatives à la durabilité et les défis associés, veuillez consulter le site https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland.

Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Comme indiqué ci-dessus, le Fonds détenait 2 % de son actif net dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif social au cours de la période couverte par les présents états financiers. Étant donné que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social, ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2022, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et sociales, car tous les investissements du Fonds ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion. Comme indiqué plus en détail ci-dessus, à cette date, le Fonds a investi 25 % de son actif net dans des investissements durables.

Par conséquent, au 31 décembre 2022, aucun investissement au sein du portefeuille était non aligné sur les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé auprès des sociétés et des émetteurs sur des questions importantes liées au climat et a cherché à encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 *bis*, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Fonds PIMCO ESG Income Fund **Identifiant d'entité juridique :** 549300TKMFF4LMUCRB73

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable,** on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ **Oui**

☐ **Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ %**

- ☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
- ☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ **Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %**

☑ **Non**

☑ **Il promouvait des caractéristiques environnementales/sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 32 % d'investissements durables**

- ☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
- ☑ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
- ☑ ayant un objectif social**

** Bien que le Fonds ait investi dans des investissements durables ayant un objectif social au cours de la période couverte par le présent rapport, il n'a pris aucun engagement à investir dans cette catégorie d'investissements ; par conséquent, ces investissements acquis par le Fonds doivent être considérés comme accessoires par nature.

☐ **Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

L'approche du Fonds en matière d'investissement durable passe par la promotion de caractéristiques environnementales et sociales (bien que le Fonds n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables).

Comme indiqué ci-dessous, les investissements durables détenus par le Fonds au cours de la période de référence ont contribué aux objectifs environnementaux d'adaptation au changement climatique et d'atténuation du changement climatique.

Les instruments dérivés détenus par le Fonds au cours de la période ont été contrôlés par rapport à la politique d'exclusion mise en œuvre par le Conseiller en investissement et ont donc été utilisés pour promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les incidences du Fonds sur la durabilité ont été mesurées par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement envers les émetteurs, de sa stratégie d'exclusion et de son investissement dans certains Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée **« Titres ESG à revenu fixe »**) qui permettent aux émetteurs de lever des capitaux pour financer des projets présentant des avantages pour l'environnement, ainsi que dans des titres de créance d'émetteurs ayant exercé un leadership dans la gestion des risques et des opportunités liés au changement climatique.

Par exemple, le processus de présélection du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans le charbon et le pétrole. En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, le cas échéant.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Les investissements durables sous-jacents du Fonds ont principalement contribué aux objectifs environnementaux d'atténuation du changement climatique et d'adaptation au changement climatique au cours de la période de référence, et ce, de diverses manières, y compris, à titre d'exemple, l'investissement dans des Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée **« Titres ESG à revenu fixe »**), dont les obligations vertes.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les investissements durables du Fonds ont été évalués afin de s'assurer qu'ils ne causent pas de préjudice important à tout objectif environnemental ou social. Cette évaluation a été

réalisée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de divers indicateurs de durabilité défavorables, y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition au charbon et au pétrole et les émissions de gaz à effet de serre.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les titres ont été sélectionnés selon le processus de présélection interne du Conseiller en investissement en matière de durabilité. Ce processus de présélection comprend la prise en compte des incidences négatives sur les facteurs de durabilité, notamment l'exposition au secteur du charbon et du pétrole, ainsi qu'aux armes controversées. Le Conseiller en investissement a cherché à atténuer les principales incidences négatives, notamment par le biais de l'engagement auprès des émetteurs et de la présélection des exclusions.

***Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée** :*

Le Conseiller en investissement s'est assuré que les investissements durables étaient alignés sur les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et sur les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme par le biais d'une présélection des controverses du Pacte mondial des Nations unies ainsi que d'autres instruments, notamment les scores et les recherches ESG, dans le cadre du processus de diligence raisonnable des investissements.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences des décisions d'investissement qui « entraînent des répercussions négatives sur les facteurs de durabilité », les facteurs de durabilité étant définis comme « les questions environnementales, sociales et de personnel, le respect des droits de l'homme, la lutte contre la corruption et les actes de corruption ».

Le Fonds a pris en considération les principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité (y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition au charbon et au pétrole, les émissions de gaz à effet de serre et l'exposition aux armes controversées) au cours de la période de référence.

Le Conseiller en investissement a visé à prendre en considération les principales incidences négatives dans le cadre du processus d'investissement et a utilisé une combinaison de méthodes pour contribuer à atténuer les principales incidences négatives, y compris l'engagement auprès des émetteurs et les exclusions.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir au 31 décembre 2022

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Bons du Trésor américain 4,386 % échéance 30/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	14,55 %	États-Unis
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/02/2053	Titrisé	6,54 %	États-Unis
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/02/2053	Titrisé	4,57 %	États-Unis
International Bank for Reconstruction & Development 3,000 % échéance 27/09/2023	Autres instruments nets à duration courte	4,55 %	Supranationales
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	Titrisé	3,83 %	États-Unis
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/01/2053	Titrisé	3,19 %	États-Unis
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/03/2053	Titrisé	2,92 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/01/2032	Titres liés au gouvernement américain	2,46 %	États-Unis
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/02/2053	Titrisé	2,27 %	États-Unis
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/02/2053	Titrisé	1,92 %	États-Unis
EMF-UK PLC 4,491 % échéance 13/03/2046	Autres instruments nets à duration courte	1,76 %	Royaume-Uni
Towd Point Mortgage Funding PLC 3,596 % échéance 20/10/2051	Autres instruments nets à duration courte	1,48 %	Royaume-Uni
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 6,000 % échéance 01/01/2053	Titrisé	1,37 %	États-Unis
Fannie Mae 3,500 % échéance 01/08/2059	Titrisé	1,30 %	États-Unis
Bons du Trésor américain 4,050 % échéance 26/01/2023	Autres instruments nets à duration courte	1,26 %	États-Unis

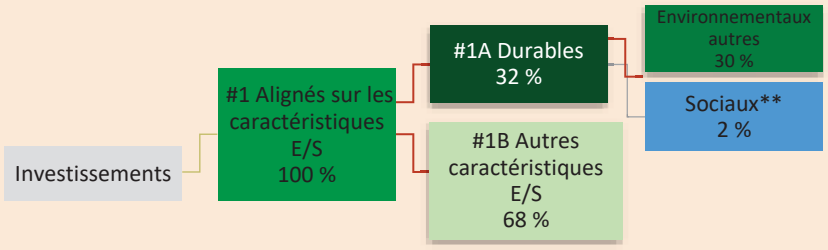
Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la proportion du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales et la proportion du Fonds investie dans des investissements durables au 31 décembre 2022 sont fournies ci-dessous.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **# 1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :
- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Au 31 décembre 2022, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et sociales, car tous les investissements du Fonds ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion.

À cette date, le Fonds a investi 32 % de son actif net dans des investissements durables. 30 % de l'actif net ont été investis dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif environnemental.

**Le Fonds détenait également 2 % de son actif net dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social. Il convient de noter que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social et que ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
Titrisé	42,87 %
Autres instruments nets à duration courte	36,04 %
Investment Grade Credit	12,54 %

Crédit à haut rendement	4,45 %
Marchés émergents	4,32 %
Liés au gouvernement américain	3,49 %
Autre	0,23 %
Pays développés hors USD	-3,94 %

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Au 31 décembre 2022, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie européenne est de 0 %. Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un auditeur et n'a pas été examiné par un tiers.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE[1] ?

☐ **Oui :**

☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

☑ **Non**

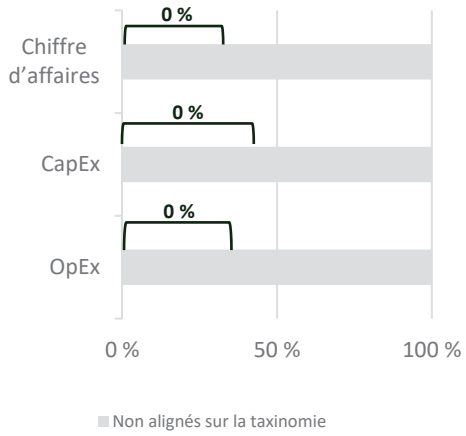
[1] Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

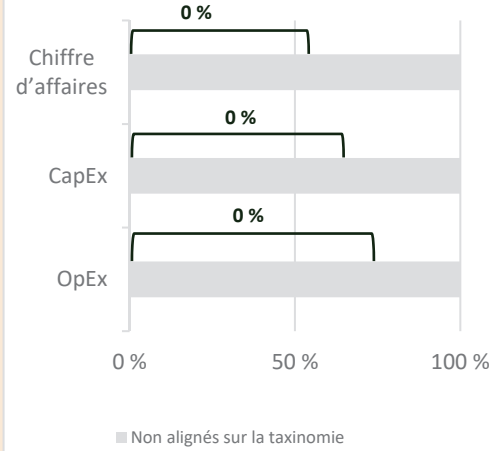
- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autre que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, **dont obligations souveraines***



2. Alignement des investissements sur la taxinomie, **hors obligations souveraines***



***Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines**

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 %.

Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE, mais s'engage à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif environnemental. Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements durables du Fonds qui ont contribué à un objectif environnemental sans être évalués par rapport à la taxinomie de l'UE et qui, par conséquent, étaient classés dans la catégorie « Environnementaux autres » ci-dessus est de 30 %. Pour de plus amples informations concernant la disponibilité des données relatives à la durabilité et les défis associés, veuillez consulter le site https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland.

Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Comme indiqué ci-dessus, le Fonds détenait 2 % de son actif net dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif social au cours de la période couverte par les présents états financiers. Étant donné que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social, ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2022, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et sociales, car tous les investissements du Fonds ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion. Comme indiqué plus en détail ci-dessus, à cette date, le Fonds a investi 32 % de son actif net dans des investissements durables.

Par conséquent, au 31 décembre 2022, aucun investissement au sein du portefeuille était non aligné sur les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé auprès des sociétés et des émetteurs sur des questions importantes liées au climat et a cherché à encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 *bis*, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Fonds Euro Bond Fund **Identifiant d'entité juridique :** U8E5120AOPVSYI2B4U46

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ **Oui**	☑ **Non**
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental :** ___ %	☐ Il **promouvait des caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social :** ___ %	☑ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Par **investissement durable,** on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental.** Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds a promu les caractéristiques environnementales en comparant tous les investissements directs à la politique d'exclusion du Fonds. Le Fonds a également promu des caractéristiques environnementales en s'engageant activement auprès des émetteurs sur les questions importantes liées au climat, qui ont inclus le fait d'encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les incidences du Fonds sur la durabilité ont été mesurées par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement auprès des émetteurs, ainsi que de sa stratégie d'exclusion. La stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds s'appliquent à 100 % de ses investissements directs.

Par exemple, le processus de présélection du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans le charbon et le pétrole non conventionnel (comme le pétrole arctique et les sables bitumineux). En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes acceptées à l'échelle mondiale telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies, le cas échéant.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion des investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir au 31 décembre 2022

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	Autres instruments nets à duration courte	9,49 %	Irlande
Obligation internationale de l'État espagnol 0,000 % échéance 31/01/2026	Titres liés à un gouvernement	3,73 %	Espagne
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % échéance 01/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	3,36 %	Japon
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/02/2053	Titrisé	2,96 %	États-Unis d'Amérique
Bons du Trésor japonais (0,117) % échéance 20/02/2023	Autres instruments nets à duration courte	2,69 %	Japon
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % échéance 01/10/2050	Investment Grade Credit	1,93 %	Danemark
Bons du Trésor japonais (0,160) % échéance 30/01/2023	Autres instruments nets à duration courte	1,50 %	Japon
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % échéance 15/10/2027	Titres liés à un gouvernement	1,47 %	États-Unis d'Amérique
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 3,000 % échéance 01/02/2053	Titrisé	1,40 %	États-Unis d'Amérique
Bons du Trésor japonais (0,182) % échéance 20/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	1,27 %	Japon
Obligation internationale de l'État espagnol 1,450 % échéance 31/10/2027	Titres liés à un gouvernement	1,13 %	Espagne
Stratton Mortgage Funding PLC 3,826 % échéance 20/07/2060	Autres instruments nets à duration courte	0,91 %	Royaume-Uni
Obligation internationale de l'État espagnol 1,400 % échéance 30/07/2028	Titres liés à un gouvernement	0,91 %	Espagne
Bons du Trésor japonais (0,171) % échéance 20/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	0,86 %	Japon
Obligation internationale de l'État slovène 5,250 % échéance 18/02/2024	Titres liés à un gouvernement	0,85 %	Slovénie

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la proportion du Fonds qui a promu les caractéristiques environnementales/sociales au 31 décembre 2022 sont fournies ci-dessous.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 décembre 2022, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant les caractéristiques environnementales, car la stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds ont été appliqués à tous ses investissements directs. Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
Titres liés à un gouvernement	63,06 %
Investment Grade Credit	10,63 %
Autres instruments nets à duration courte	8,05 %
Titrisé	7,32 %
Obligations couvertes et Pfandbriefe	6,02 %
Titres liés à l'inflation	3,51 %
Pays émergents extérieur	2,65 %
Crédit à haut rendement	-1,24 %

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les participations du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisées.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Au 31 décembre 2022, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie européenne est de 0 %. Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un auditeur et n'a pas été examiné par un tiers.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE[1] ?

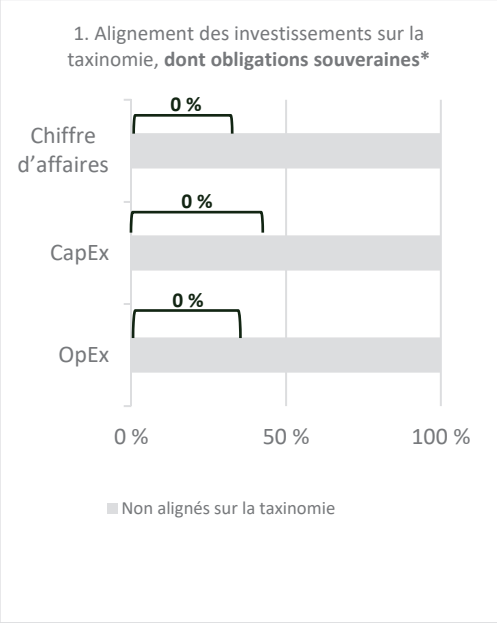
☐ **Oui :**

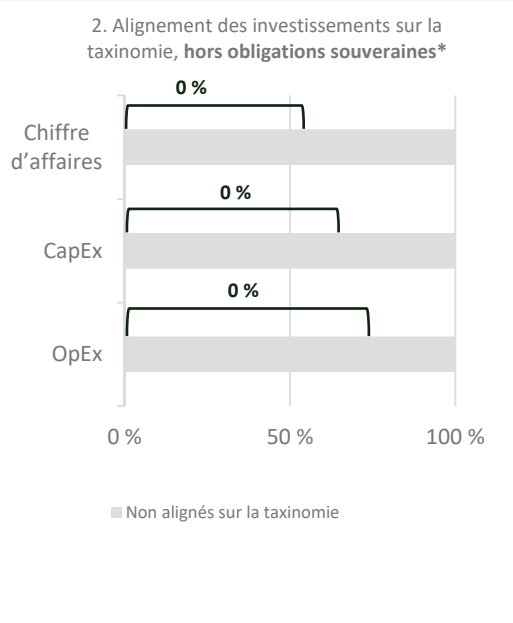
☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

☑ **Non**

[1] Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autre que les obligations souveraines.





**Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines*

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 %.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2022, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant les caractéristiques environnementales, car la stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds ont été appliqués à tous ses investissements directs.

Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé auprès des sociétés et des émetteurs sur des questions importantes liées au climat et a cherché à encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 *bis*, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Fonds Euro Credit Fund **Identifiant d'entité juridique :** RJV2Q25HZY9ZSGZSMB60

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable,** on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ **Oui**	☑ **Non**
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental :** ___ %	☐ Il **promouvait des caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social :** ___ %	☑ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds a promu les caractéristiques environnementales en comparant tous les investissements directs à la politique d'exclusion du Fonds. Le Fonds a également promu des caractéristiques environnementales en s'engageant activement auprès des émetteurs sur les questions importantes liées au climat, qui ont inclus le fait d'encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les incidences du Fonds sur la durabilité ont été mesurées par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement auprès des émetteurs, ainsi que de sa stratégie d'exclusion. La stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds s'appliquent à 100 % de ses investissements directs.

Par exemple, le processus de présélection du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans le charbon et le pétrole non conventionnel (comme le pétrole arctique et les sables bitumineux). En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes acceptées à l'échelle mondiale telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies, le cas échéant.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir au 31 décembre 2022.

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	Autres instruments nets à duration courte	8,31 %	Irlande
UBS Group AG 1,250 % échéance 17/04/2025	Investment Grade Credit	1,97 %	Suisse
Wells Fargo & Co. 1,000 % échéance 02/02/2027	Investment Grade Credit	1,74 %	États-Unis
Banque Fédérative du Crédit Mutuel S.A. 0,625 % échéance 19/11/2027	Investment Grade Credit	1,71 %	France
Nationwide Building Society 4,363 % échéance 01/08/2024	Investment Grade Credit	1,55 %	Royaume-Uni
Bons du Trésor allemand 0,958 % échéance 18/01/2023	Autres instruments nets à duration courte	1,51 %	Allemagne
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/01/2053	Titrisé	1,24 %	États-Unis
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % échéance 01/10/2050	Investment Grade Credit	1,22 %	Danemark
Nordea Kredit Realkreditaktieselskab 1,000 % échéance 01/10/2050	Investment Grade Credit	1,21 %	Danemark
Santander UK Group Holdings PLC 0,603 % échéance 13/09/2029	Investment Grade Credit	1,20 %	Royaume-Uni
BPCE S.A. 0,500 % échéance 15/09/2027	Investment Grade Credit	1,20 %	France
BNP Paribas S.A. 1,904 % échéance 30/09/2028	Investment Grade Credit	1,15 %	France
Barclays PLC 0,577 % échéance 09/08/2029	Investment Grade Credit	1,08 %	Royaume-Uni
Goldman Sachs Group, Inc. 0,875 % échéance 09/05/2029	Investment Grade Credit	1,07 %	États-Unis
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide 2,125 % échéance 09/07/2027	Investment Grade Credit	1,06 %	Allemagne

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

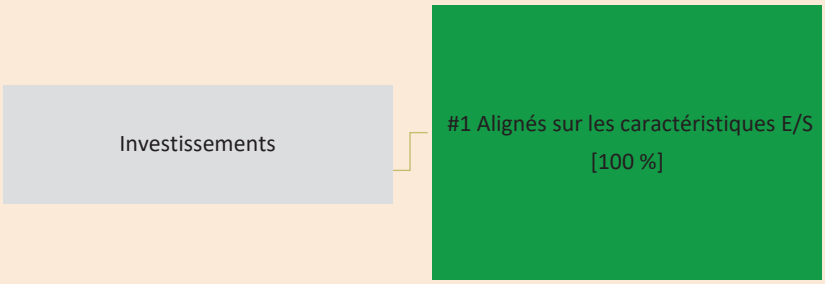
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la proportion du Fonds qui a promu les caractéristiques environnementales/sociales au 31 décembre 2022 sont fournies ci-dessous.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 décembre 2022, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant les caractéristiques environnementales, car la stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds ont été appliqués à tous ses investissements directs. Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
Investment Grade Credit	60,76 %
Titres liés à un gouvernement	26,71 %
Autres instruments nets à duration courte	6,14 %
Crédit à haut rendement	3,34 %
Titrisé	2,16 %
Marchés émergents	0,89 %

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les participations du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisées.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Au 31 décembre 2022, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie européenne est de 0 %. Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un auditeur et n'a pas été examiné par un tiers.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE[1] ?

☐ **Oui :**

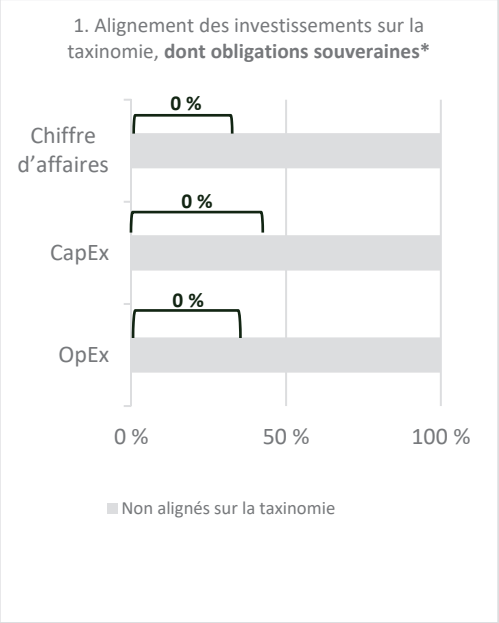
☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

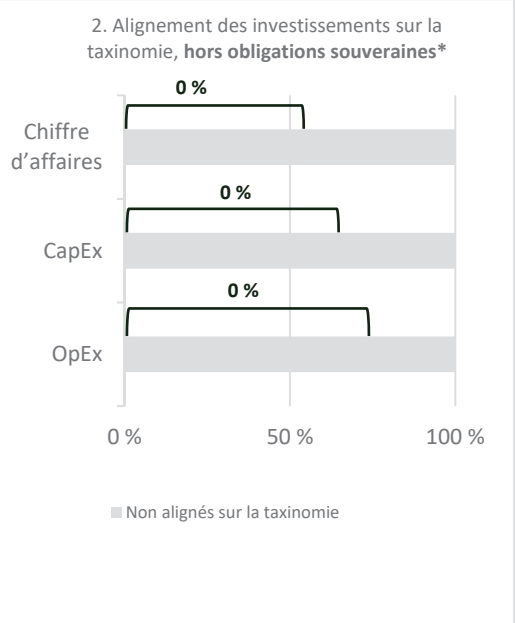
☑ **Non**

[1] Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autre que les obligations souveraines.





Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 %.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2022, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant les caractéristiques environnementales, car la stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds ont été appliqués à tous ses investissements directs.

Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé auprès des sociétés et des émetteurs sur des questions importantes liées au climat et a cherché à encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 *bis*, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Fonds Income Bond Fund **Identifiant d'entité juridique** : SEK18YSZLD2OP25KSR60

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ **Oui**	☑ **Non**
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental :** ___ %	☐ Il **promouvait des caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social :** ___ %	☑ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Par **investissement durable,** on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental.** Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds a promu les caractéristiques environnementales en comparant tous les investissements directs à la politique d'exclusion du Fonds. Le Fonds a également promu des caractéristiques environnementales en s'engageant activement auprès des émetteurs sur les questions importantes liées au climat, qui ont inclus le fait d'encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les incidences du Fonds sur la durabilité ont été mesurées par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement auprès des émetteurs, ainsi que de sa stratégie d'exclusion. La stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds s'appliquent à 100 % de ses investissements directs.

Par exemple, le processus de présélection du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans le charbon et le pétrole non conventionnel (comme le pétrole arctique et les sables bitumineux). En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes acceptées à l'échelle mondiale telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies, le cas échéant.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande **proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir au 31 décembre 2022

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
PIMCO ETFs plc - PIMCO Euro Short Maturity UCITS ETF	Autres instruments nets à duration courte	8,87 %	Irlande
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,000 % échéance 01/02/2053	Titrisé	3,48 %	États-Unis
Bons du Trésor japonais (0,179) % échéance 27/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	2,87 %	Japon
Bons du Trésor japonais (0,198) % échéance 27/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	2,32 %	Japon
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 5,500 % échéance 01/02/2053	Titrisé	1,76 %	États-Unis
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 3,000 % échéance 01/02/2053	Titrisé	1,53 %	États-Unis
Fairfax Financial Holdings Ltd. 2,750 % échéance 29/03/2028	Investment Grade Credit	1,40 %	Canada
Nykredit Realkredit A/S 1,000 % échéance 01/10/2053	Investment Grade Credit	1,24 %	Danemark
PIMCO Funds : Global Investors Series plc - PIMCO European High Yield Bond Fund	Crédit à haut rendement	1,09 %	Irlande
Lincoln Financing SARL 3,625 % échéance 01/04/2024	Crédit à haut rendement	1,05 %	Luxembourg
HSBC Holdings PLC 1,589 % échéance 24/05/2027	Investment Grade Credit	1,05 %	Royaume-Uni
Loxam S.A.S. 3,250 % échéance 14/01/2025	Crédit à haut rendement	1,03 %	France
Bons du Trésor français 0,253 % échéance 04/01/2023	Autres instruments nets à duration courte	1,01 %	France
Societa per Azioni Esercizi Aeroportuali SEA spa 3,500 % échéance 09/10/2025	Crédit à haut rendement	0,96 %	Italie
Syngenta Finance NV 3,375 % échéance 16/04/2026	Invest. Grade Credit	0,95 %	Pays-Bas

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

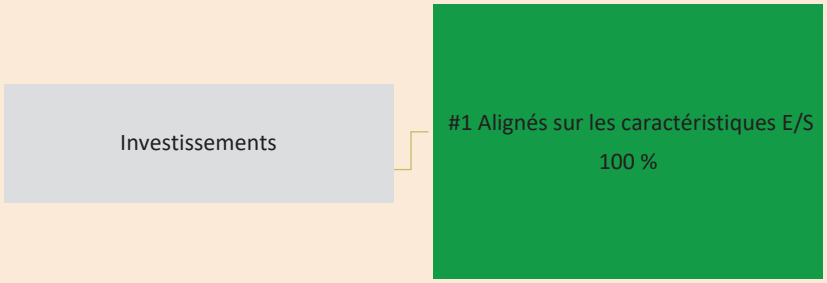
Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la proportion du Fonds qui a promu les caractéristiques environnementales/sociales au 31 décembre 2022 sont fournies ci-dessous.

Quelle était l'allocation des actifs ?

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Au 31 décembre 2022, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant les caractéristiques environnementales, car la stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds ont été appliqués à tous ses investissements directs. Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
Autres instruments nets à duration courte	66,61 %
Investment Grade Credit	32,98 %
Crédit à haut rendement	20,82 %
Titrisé	10,00 %
Marchés émergents	2,25 %
Titres liés à un gouvernement	-32,66 %

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les participations du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisées.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Au 31 décembre 2022, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie européenne est de 0 %. Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un auditeur et n'a pas été examiné par un tiers.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE[1] ?

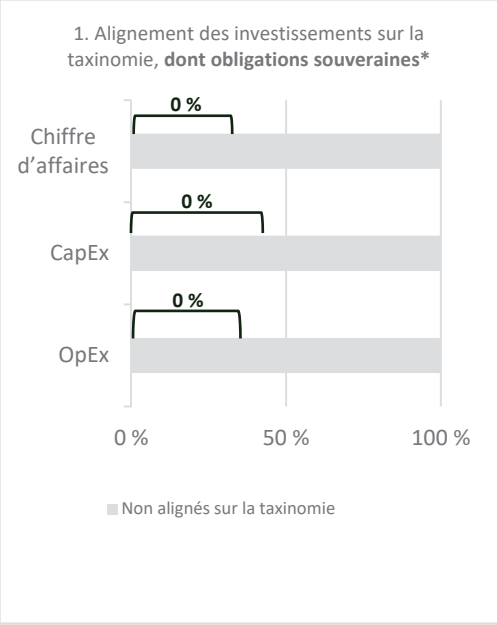
Oui :

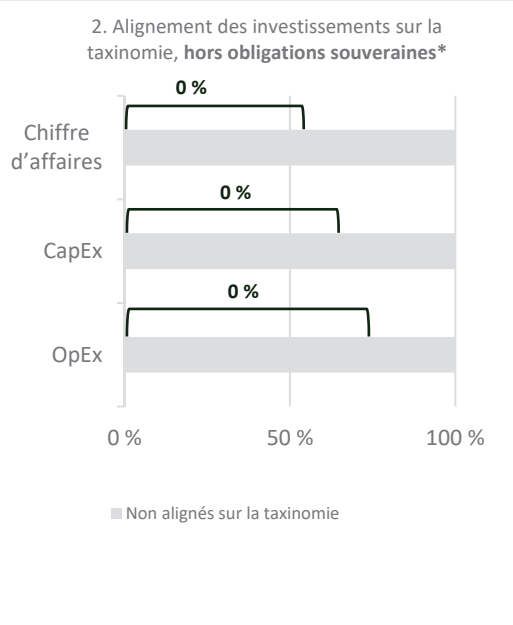
Dans le gaz fossile Dans l'énergie nucléaire

✓ **Non**

[1] Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autre que les obligations souveraines.





**Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines*

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 %.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2022, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant les caractéristiques environnementales, car la stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds ont été appliqués à tous ses investissements directs.

Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé auprès des sociétés et des émetteurs sur des questions importantes liées au climat et a cherché à encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 *bis*, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Fonds Short-Term Fund **Identifiant d'entité juridique** : U9SVFXJNHHFXARCR1V87

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable,** on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental.** Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ **Oui**	☑ **Non**
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental :** ___ %	☐ Il **promouvait des caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social :** ___ %	☑ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds a promu les caractéristiques environnementales en comparant tous les investissements directs à la politique d'exclusion du Fonds. Le Fonds a également promu des caractéristiques environnementales en s'engageant activement auprès des émetteurs sur les questions importantes liées au climat, qui ont inclus le fait d'encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les incidences du Fonds sur la durabilité ont été mesurées par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement auprès des émetteurs, ainsi que de sa stratégie d'exclusion. La stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds s'appliquent à 100 % de ses investissements directs.

Par exemple, le processus de présélection du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans le charbon et le pétrole non conventionnel (comme le pétrole arctique et les sables bitumineux). En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes acceptées à l'échelle mondiale telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies, le cas échéant.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir au 31 décembre 2022

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Bons du Trésor japonais (0,209) % échéance 06/01/2023	Titres liés à un gouvernement	2,68 %	Japon
Bons du Trésor japonais (0,159) % échéance 23/01/2023	Titres liés à un gouvernement	2,42 %	Japon
Sumitomo Mitsui Banking Corp. 0,550 % échéance 11/06/2023	Investment Grade Credit	2,02 %	Japon
BNZ International Funding Ltd. 0,625 % échéance 07/03/2025	Investment Grade Credit	1,66 %	Nouvelle-Zélande
Bank of China Ltd. 3,772 % échéance 08/10/2023	Marchés émergents	1,59 %	Chine
Korea Housing Finance Corp. 0,723 % échéance 22/03/2025	Titres liés à un gouvernement	1,51 %	Corée du Sud
Trinity Square PLC 3,729 % échéance 15/07/2059	Titrisé	1,50 %	Royaume-Uni
AMCO - Asset Management Co. SpA 1,500 % échéance 17/07/2023	Titres liés à un gouvernement	1,18 %	Italie
Avon Finance PLC 4,331 % échéance 20/09/2048	Titrisé	1,09 %	Royaume-Uni
Dexia Credit Local S.A. 0,250 % échéance 06/01/2023	Titres liés à un gouvernement	1,07 %	France
Bain Capital Euro CLO DAC 2,196 % échéance 20/01/2032	Titrisé	1,05 %	Irlande
Bons du Trésor japonais (0,191) % échéance 06/01/2023	Titres liés à un gouvernement	1,00 %	Japon
Freddie Mac 0,800 % échéance 28/10/2026	Titres liés à un gouvernement	0,97 %	États-Unis
Virgin Money UK PLC 0,375 % échéance 27/05/2024	Investment Grade Credit	0,95 %	Royaume-Uni
Stratton Mortgage Funding PLC 3,826 % échéance 20/07/2060	Titrisé	0,94 %	Royaume-Uni

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la proportion du Fonds qui a promu les caractéristiques environnementales/sociales au 31 décembre 2022 sont fournies ci-dessous.

Quelle était l'allocation des actifs ?

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Au 31 décembre 2022, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant les caractéristiques environnementales, car la stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds ont été appliqués à tous ses investissements directs. Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
Investment Grade Credit	48,96 %
Titrisé	21,53 %
Autres instruments nets à duration courte	16,09 %
Titres liés à un gouvernement	8,62 %
Crédit à haut rendement	2,77 %
Marchés émergents	2,03 %

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les participations du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisées.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Au 31 décembre 2022, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie européenne est de 0 %. Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un auditeur et n'a pas été examiné par un tiers.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE[1] ?

☐ **Oui :**

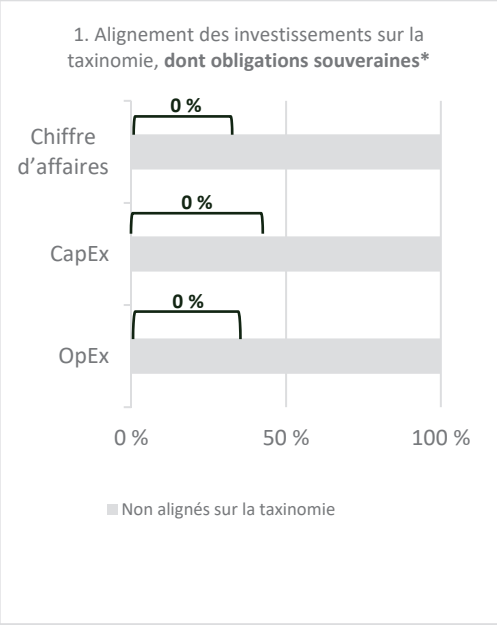
☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

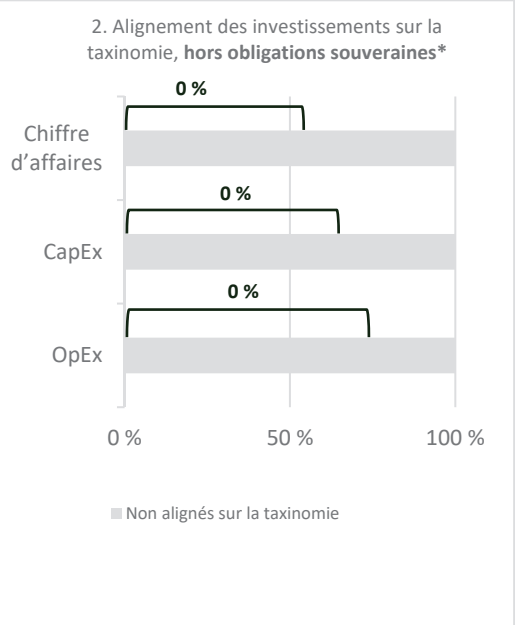
☑ **Non**

[1] Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autre que les obligations souveraines.





**Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines*

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 %.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2022, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant les caractéristiques environnementales, car la stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds ont été appliqués à tous ses investissements directs.

Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé auprès des sociétés et des émetteurs sur des questions importantes liées au climat et a cherché à encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 *bis*, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Fonds Global Bond ESG Fund **Identifiant d'entité juridique :** 549300PFJAUUMMOPU079

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable,** on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ **Oui**	☑ **Non**
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental :** ___ %	☑ Il **promouvait des caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 15 % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☑ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☑ ayant un objectif social**
	** Bien que le Fonds ait investi dans des investissements durables ayant un objectif social au cours de la période couverte par le présent rapport, il n'a pris aucun engagement à investir dans cette catégorie d'investissements ; par conséquent, ces investissements acquis par le Fonds doivent être considérés comme accessoires par nature.
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social :** ___ %	☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

L'approche du Fonds en matière d'investissement durable passe par la promotion de caractéristiques environnementales et sociales (bien que le Fonds n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables).

Comme indiqué ci-dessous, les investissements durables détenus par le Fonds au cours de la période de référence ont contribué aux objectifs environnementaux d'adaptation au changement climatique et d'atténuation du changement climatique.

Les instruments dérivés détenus par le Fonds au cours de la période ont été contrôlés par rapport à la politique d'exclusion mise en œuvre par le Conseiller en investissement et ont donc été utilisés pour promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les incidences du Fonds sur la durabilité ont été mesurées par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement envers les émetteurs, de sa stratégie d'exclusion et de son investissement dans certains Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée **« Titres ESG à revenu fixe »**) qui permettent aux émetteurs de lever des capitaux pour financer des projets présentant des avantages pour l'environnement, ainsi que dans des titres de créance d'émetteurs ayant exercé un leadership dans la gestion des risques et des opportunités liés au changement climatique.

Par exemple, le processus de présélection du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans le charbon et le pétrole. En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, le cas échéant.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Les investissements durables sous-jacents du Fonds ont principalement contribué aux objectifs environnementaux d'atténuation du changement climatique et d'adaptation au changement climatique au cours de la période de référence, et ce, de diverses manières, y compris, à titre d'exemple, l'investissement dans des Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée **« Titres ESG à revenu fixe »**), dont les obligations vertes.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les investissements durables du Fonds ont été évalués afin de s'assurer qu'ils ne causent pas de préjudice important à tout objectif environnemental ou social. Cette évaluation a été réalisée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de divers indicateurs de durabilité défavorables, y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition au charbon et au pétrole et les émissions de gaz à effet de serre.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les titres ont été sélectionnés selon le processus de présélection interne du Conseiller en investissement en matière de durabilité. Ce processus de présélection comprend la prise en compte des incidences négatives sur les facteurs de durabilité, notamment l'exposition au secteur du charbon et du pétrole, ainsi qu'aux armes controversées. Le Conseiller en investissement a cherché à atténuer les principales incidences négatives, notamment par le biais de l'engagement auprès des émetteurs et de la présélection des exclusions.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le Conseiller en investissement s'est assuré que les investissements durables étaient alignés sur les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et sur les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme par le biais d'une présélection des controverses du Pacte mondial des Nations unies ainsi que d'autres instruments, notamment les scores et les recherches ESG, dans le cadre du processus de diligence raisonnable des investissements.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences des décisions d'investissement qui « entraînent des répercussions négatives sur les facteurs de durabilité », les facteurs de durabilité étant définis comme « les questions environnementales, sociales et de personnel, le respect des droits de l'homme, la lutte contre la corruption et les actes de corruption ».

Le Fonds a pris en considération les principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité (y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition au charbon et au pétrole, les émissions de gaz à effet de serre et l'exposition aux armes controversées) au cours de la période de référence.

Le Conseiller en investissement a visé à prendre en considération les principales incidences négatives dans le cadre du processus d'investissement et a utilisé une combinaison de méthodes pour contribuer à atténuer les principales incidences négatives, y compris l'engagement auprès des émetteurs et les exclusions.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir au 31 décembre 2022

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Bons du Trésor américain 4,389 % échéance 30/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	6,68 %	États-Unis
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 3,000 % échéance 01/01/2053	Titrisé	3,51 %	États-Unis
Bons du Trésor japonais (0,146) % échéance 06/02/2023	Autres instruments nets à duration courte	3,16 %	Japon
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/01/2053	Titrisé	2,94 %	États-Unis
Bons du Trésor japonais (0,111) % échéance 20/02/2023	Autres instruments nets à duration courte	2,47 %	Japon
Bons du Trésor japonais (0,118) % échéance 13/02/2023	Autres instruments nets à duration courte	2,11 %	Japon
Bons du Trésor japonais (0,209) % échéance 06/01/2023	Autres instruments nets à duration courte	1,99 %	Japon
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/01/2053	Titrisé	1,95 %	États-Unis
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,500 % échéance 01/02/2053	Titrisé	1,70 %	États-Unis
République d'Allemagne 0,000 % échéance 15/08/2031	Titres liés à un gouvernement	1,49 %	Allemagne
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 3,500 % échéance 01/01/2053	Titrisé	1,49 %	États-Unis
Bons du Trésor japonais (0,129) % échéance 13/02/2023	Autres instruments nets à duration courte	1,39 %	Japon
Bons du Trésor japonais (0,182) % échéance 20/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	1,27 %	Japon
Bons du Trésor israéliens 0,532 % échéance 02/08/2023	Autres instruments nets à duration courte	1,26 %	Israël
Bons du Trésor japonais (0,203) % échéance 16/01/2023	Autres instruments nets à duration courte	1,18 %	Japon

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la proportion du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales et la proportion du Fonds investie dans des investissements durables au 31 décembre 2022 sont fournies ci-dessous.

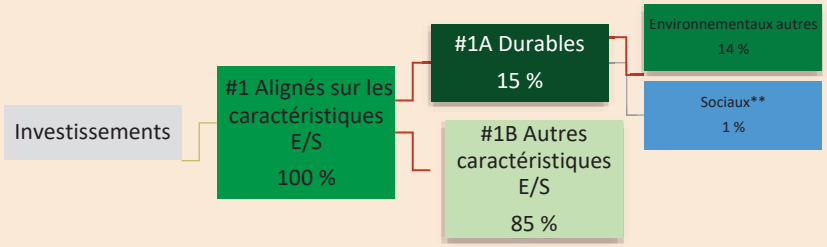
L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **# 1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :
- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Au 31 décembre 2022, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et sociales, car tous les investissements du Fonds ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion.

À cette date, le Fonds a investi 15 % de son actif net dans des investissements durables. 14 % de l'actif net ont été investis dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif environnemental.

**Le Fonds détenait également 1 % de son actif net dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social. Il convient de noter que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social et que ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
Titres liés à un gouvernement	43,70 %
Autres instruments nets à duration courte	16,61 %
Titrisé	16,52 %
Investment Grade Credit	11,27 %
Marché émergent extérieur	5,19 %
Obligations couvertes et Pfandbriefe	2,08 %
Titres liés à l'inflation	1,99 %
Marché émergent local	1,57 %
Crédit à haut rendement	0,88 %
Municipaux	0,19 %

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Au 31 décembre 2022, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie européenne est de 0 %. Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un auditeur et n'a pas été examiné par un tiers.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE[1] ?

☐ **Oui :**

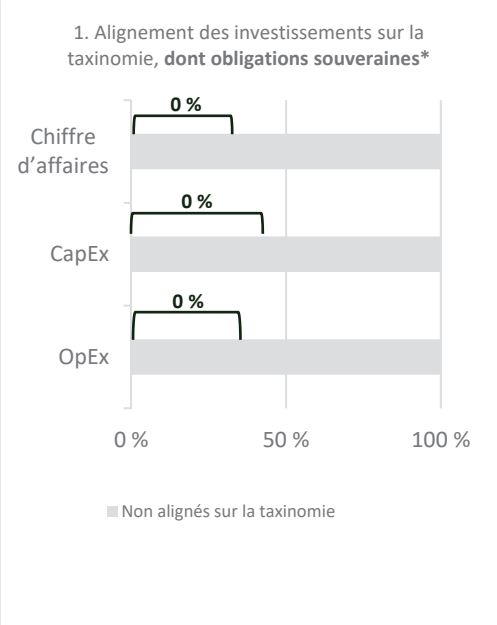
☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

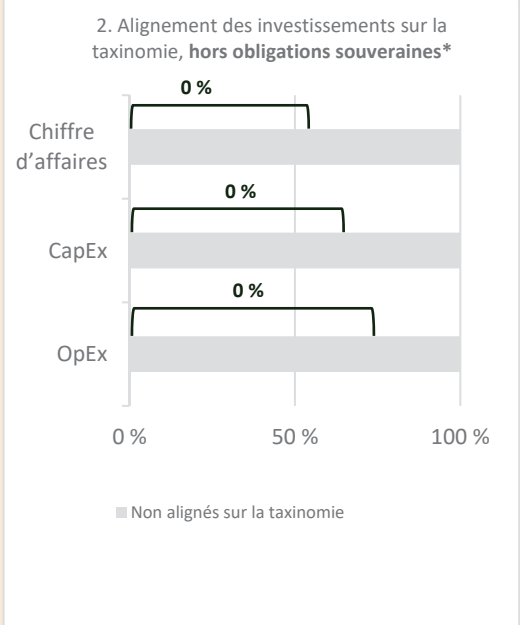
☑ **Non**

[1] Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autre que les obligations souveraines.





**Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines*

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 %.

Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE, mais s'engage à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif environnemental. Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements durables du Fonds qui ont contribué à un objectif environnemental sans être évalués par rapport à la taxinomie de l'UE et qui, par conséquent, étaient classés dans la catégorie « Environnementaux autres » ci-dessus est de 14 %. Pour de plus amples informations concernant la disponibilité des données relatives à la durabilité et les défis associés, veuillez consulter le site https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland.

Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Comme indiqué ci-dessus, le Fonds détenait 1 % de son actif net dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif social au cours de la période couverte par les présents états financiers. Étant donné que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social, ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2022, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et sociales, car tous les investissements du Fonds ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion. Comme indiqué plus en détail ci-dessus, à cette date, le Fonds a investi 15 % de son actif net dans des investissements durables.

Par conséquent, au 31 décembre 2022, aucun investissement au sein du portefeuille était non aligné sur les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé auprès des sociétés et des émetteurs sur des questions importantes liées au climat et a cherché à encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 *bis*, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Fonds Global Investment Grade Credit ESG Fund **Identifiant d'entité juridique :** 5493005HZUTWLN5JSJ59

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable,** on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ **Oui**	☑ **Non**
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental :** ___ %	☑ Il **promouvait des caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 60 % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☑ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☑ ayant un objectif social**
	** Bien que le Fonds ait investi dans des investissements durables ayant un objectif social au cours de la période couverte par le présent rapport, il n'a pris aucun engagement à investir dans cette catégorie d'investissements ; par conséquent, ces investissements acquis par le Fonds doivent être considérés comme accessoires par nature.
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social :** ___ %	☐ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

L'approche du Fonds en matière d'investissement durable passe par la promotion de caractéristiques environnementales et sociales (bien que le Fonds n'ait pas pour objectif

l'investissement durable, il cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables).

Comme indiqué ci-dessous, les investissements durables détenus par le Fonds au cours de la période de référence ont contribué aux objectifs environnementaux d'adaptation au changement climatique et d'atténuation du changement climatique.

Les instruments dérivés détenus par le Fonds au cours de la période ont été contrôlés par rapport à la politique d'exclusion mise en œuvre par le Conseiller en investissement et ont donc été utilisés pour promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les incidences du Fonds sur la durabilité ont été mesurées par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement envers les émetteurs, de sa stratégie d'exclusion et de son investissement dans certains Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée **« Titres ESG à revenu fixe »**) qui permettent aux émetteurs de lever des capitaux pour financer des projets présentant des avantages pour l'environnement, ainsi que dans des titres de créance d'émetteurs ayant exercé un leadership dans la gestion des risques et des opportunités liés au changement climatique.

Par exemple, le processus de présélection du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans le charbon et le pétrole. En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, le cas échéant.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Les investissements durables sous-jacents du Fonds ont principalement contribué aux objectifs environnementaux d'atténuation du changement climatique et d'adaptation au changement climatique au cours de la période de référence, et ce, de diverses manières, y compris, à titre d'exemple, l'investissement dans des Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée **« Titres ESG à revenu fixe »**), dont les obligations vertes.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les investissements durables du Fonds ont été évalués afin de s'assurer qu'ils ne causent pas de préjudice important à tout objectif environnemental ou social. Cette évaluation a été réalisée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de divers indicateurs de durabilité défavorables, y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition au charbon et au pétrole et les émissions de gaz à effet de serre.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les titres ont été sélectionnés selon le processus de présélection interne du Conseiller en investissement en matière de durabilité. Ce processus de

présélection comprend la prise en compte des incidences négatives sur les facteurs de durabilité, notamment l'exposition au secteur du charbon et du pétrole, ainsi qu'aux armes controversées. Le Conseiller en investissement a cherché à atténuer les principales incidences négatives, notamment par le biais de l'engagement auprès des émetteurs et de la présélection des exclusions.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le Conseiller en investissement s'est assuré que les investissements durables étaient alignés sur les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et sur les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme par le biais d'une présélection des controverses du Pacte mondial des Nations unies ainsi que d'autres instruments, notamment les scores et les recherches ESG, dans le cadre du processus de diligence raisonnable des investissements.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences des décisions d'investissement qui « entraînent des répercussions négatives sur les facteurs de durabilité », les facteurs de durabilité étant définis comme « les questions environnementales, sociales et de personnel, le respect des droits de l'homme, la lutte contre la corruption et les actes de corruption ».

Le Fonds a pris en considération les principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité (y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition au charbon et au pétrole, les émissions de gaz à effet de serre et l'exposition aux armes controversées) au cours de la période de référence.

Le Conseiller en investissement a visé à prendre en considération les principales incidences négatives dans le cadre du processus d'investissement et a utilisé une combinaison de méthodes pour contribuer à atténuer les principales incidences négatives, y compris l'engagement auprès des émetteurs et les exclusions.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir au 31 décembre 2022

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 4,000 % échéance 01/02/2053	Titrisé	3,64 %	États-Unis
Obligations du Trésor américain 2,375 % échéance 15/02/2042	Titres liés à un gouvernement	3,19 %	États-Unis
Obligations du Trésor américain 3,250 % échéance 15/05/2042	Titres liés à un gouvernement	2,88 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % échéance 15/07/2032	Titres liés à un gouvernement	2,07 %	États-Unis
Obligations du Trésor américain 2,000 % échéance 15/11/2041	Titres liés à un gouvernement	2,06 %	États-Unis
Obligations du Trésor américain 2,250 % échéance 15/05/2041	Titres liés à un gouvernement	1,95 %	États-Unis
Obligations du Trésor américain 4,000 % échéance 15/11/2042	Titres liés à un gouvernement	1,67 %	États-Unis
Obligations du Trésor américain 1,750 % échéance 15/08/2041	Titres liés à un gouvernement	1,66 %	États-Unis
Billets du Trésor américain 0,500 % échéance 30/11/2023	Autres instruments nets à duration courte	1,60 %	États-Unis
Billets du Trésor américain 4,250 % échéance 15/10/2025	Titres liés à un gouvernement	1,58 %	États-Unis
Humana, Inc. 4,850 % échéance 19/01/2023	Autres instruments nets à duration courte	1,30 %	États-Unis
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 3,500 % échéance 01/02/2053	Titrisé	0,99 %	États-Unis
République d'Allemagne 0,000 % échéance 15/08/2031	Titres liés à un gouvernement	0,93 %	Allemagne
Bons du Trésor autrichiens 1,267 % échéance 23/02/2023	Autres instruments nets à duration courte	0,91 %	Autriche
Obligations du Trésor américain 1,875 % échéance 15/02/2041	Titres liés à un gouvernement	0,90 %	États-Unis

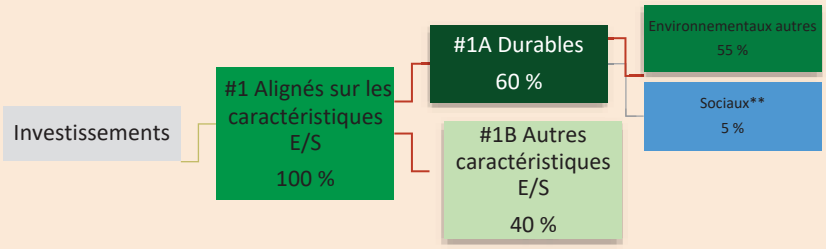
Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Des informations sur la proportion du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales et la proportion du Fonds investie dans des investissements durables au 31 décembre 2022 sont fournies ci-dessous.

Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **# 1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :
- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Au 31 décembre 2022, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et sociales, car tous les investissements du Fonds ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion.

À cette date, le Fonds a investi 60 % de son actif net dans des investissements durables. 55 % de l'actif net ont été investis dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif environnemental.

**Le Fonds détenait également 5 % de son actif net dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social. Il convient de noter que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social et que ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
Investment Grade Credit	59,48 %
Titres liés à un gouvernement	21,19 %
Titrisé	6,32 %
Marchés émergents	5,71 %
Crédit à haut rendement	4,41 %
Municipal/autre	1,53 %
Autres instruments nets à duration courte	1,36 %

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Au 31 décembre 2022, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie européenne est de 0 %. Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un auditeur et n'a pas été examiné par un tiers.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE[1] ?

☐ **Oui :**

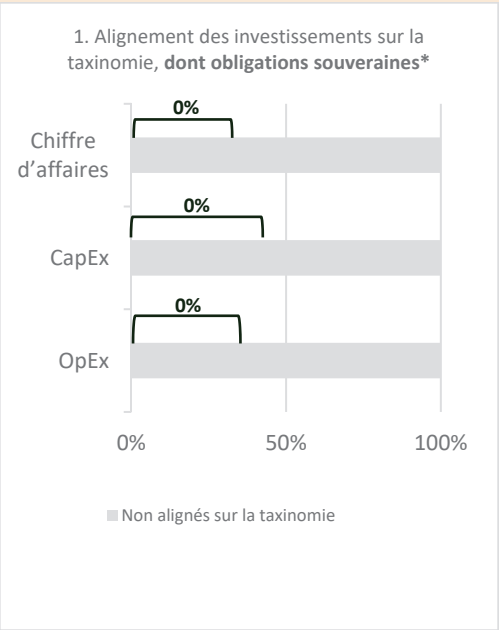
☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

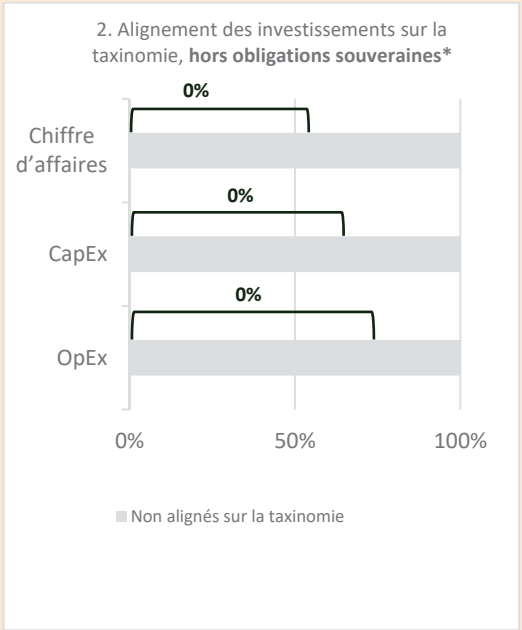
☑ **Non**

[1] Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autre que les obligations souveraines.





**Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines*

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 %.

Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE, mais s'engage à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif environnemental. Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements durables du Fonds qui ont contribué à un objectif environnemental sans être évalués par rapport à la taxinomie de l'UE et qui, par conséquent, étaient classés dans la catégorie « Environnementaux autres » ci-dessus est de 55 %. Pour de plus amples informations concernant la disponibilité des données relatives à la durabilité et les défis associés, veuillez consulter le site https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland.

Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Comme indiqué ci-dessus, le Fonds détenait 5 % de son actif net dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif social au cours de la période couverte par les présents états financiers. Étant donné que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social, ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2022, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et sociales, car tous les investissements du Fonds ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion. Comme indiqué plus en détail ci-dessus, à cette date, le Fonds a investi 60 % de son actif net dans des investissements durables.

Par conséquent, au 31 décembre 2022, aucun investissement au sein du portefeuille était non aligné sur les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé auprès des sociétés et des émetteurs sur des questions importantes liées au climat et a cherché à encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 *bis*, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Fonds Global Low Duration Real Return Fund **Identifiant d'entité juridique** : 5493004EUSX3DN7B3B79

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable,** on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020 /852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental.** Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ Oui	☑ Non
☐ **Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ %**	☐ **Il promouvait des caractéristiques environnementales/sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables**
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ **Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %**	☑ **Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds a promu les caractéristiques environnementales en comparant tous les investissements directs à la politique d'exclusion du Fonds. Le Fonds a également promu des caractéristiques environnementales en s'engageant activement auprès des émetteurs sur les questions

importantes liées au climat, qui ont inclus le fait d'encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les incidences du Fonds sur la durabilité ont été mesurées par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement auprès des émetteurs, ainsi que de sa stratégie d'exclusion. La stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds s'appliquent à 100 % de ses investissements directs.

Par exemple, le processus de présélection du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans le charbon et le pétrole non conventionnel (comme le pétrole arctique et les sables bitumineux). En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes acceptées à l'échelle mondiale telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies, le cas échéant.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande **proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir au 31 décembre 2022

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/10/2024	Titres liés à l'inflation	5,69 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/07/2026	Titres liés à l'inflation	5,69 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % échéance 15/01/2028	Titres liés à l'inflation	4,98 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/10/2025	Titres liés à l'inflation	4,89 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/10/2026	Titres liés à l'inflation	4,74 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % échéance 15/07/2025	Titres liés à l'inflation	4,32 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % échéance 15/01/2026	Titres liés à l'inflation	4,31 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,375 % échéance 15/01/2027	Titres liés à l'inflation	4,20 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % échéance 15/04/2024	Titres liés à l'inflation	4,16 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % échéance 15/01/2025	Titres liés à l'inflation	3,90 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/04/2026	Titres liés à l'inflation	3,86 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/04/2025	Titres liés à l'inflation	3,75 %	États-Unis
Bon du Trésor britannique 0,125 % échéance 22/03/2024	Titres liés à l'inflation	3,74 %	Royaume-Uni
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % échéance 15/01/2024	Titres liés à l'inflation	3,22 %	États-Unis
Bon du Trésor britannique 0,125 % échéance 22/03/2026	Titres liés à l'inflation	3,09 %	Royaume-Uni

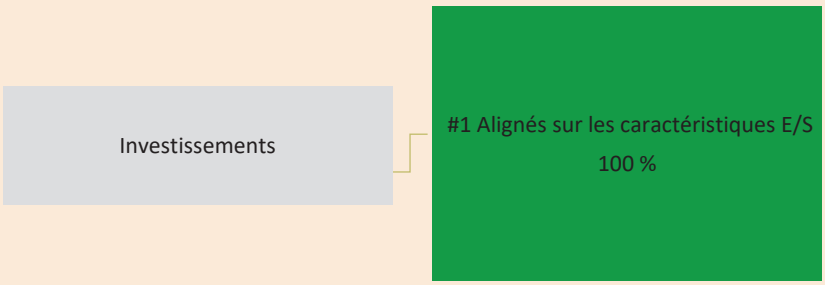
Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la proportion du Fonds qui a promu les caractéristiques environnementales/sociales au 31 décembre 2022 sont fournies ci-dessous.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 décembre 2022, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant les caractéristiques environnementales, car la stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds ont été appliqués à tous ses investissements directs. Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
Titres liés à l'inflation	96,03 %
Autres instruments nets à duration courte	13,59 %
Titrisé	4,99 %
Obligations couvertes et Pfandbriefe	2,99 %
Investment Grade Credit	0,30 %
Marché émergent local	0,07 %
Crédit à haut rendement	0,04 %
Titres liés à un gouvernement	-18,01 %

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les participations du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisées.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Au 31 décembre 2022, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie européenne est de 0 %. Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un auditeur et n'a pas été examiné par un tiers.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE[1] ?

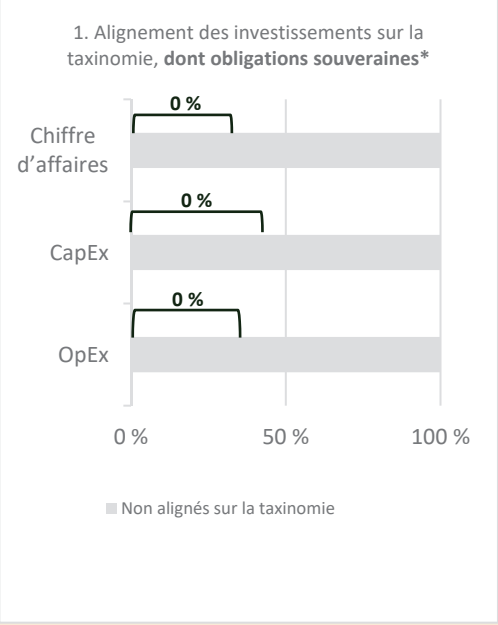
☐ **Oui :**

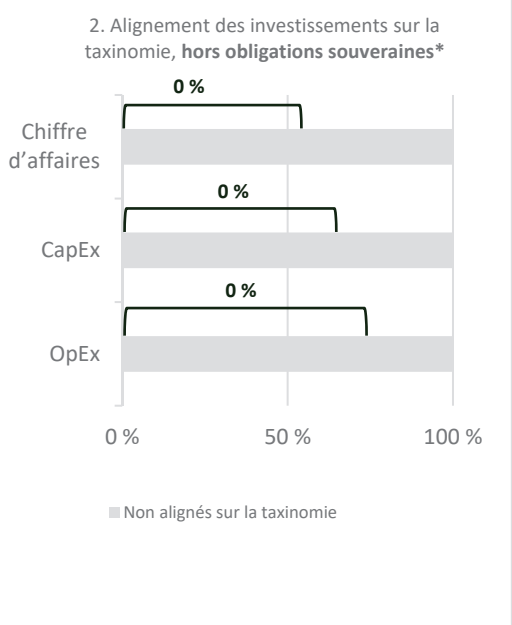
☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

☑ **Non**

[1] Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autre que les obligations souveraines.





Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 %.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2022, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant les caractéristiques environnementales, car la stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds ont été appliqués à tous ses investissements directs.

Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé auprès des sociétés et des émetteurs sur des questions importantes liées au climat et a cherché à encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 *bis*, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Fonds Global Real Return Fund **Identifiant d'entité juridique** : TJC21SOQHOBNQ288A280

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable,** on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental.** Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ **Oui**	☑ **Non**
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental :** ___ %	☐ Il **promouvait des caractéristiques environnementales/sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☐ ayant un objectif social
☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social :** ___ %	☑ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le Fonds a promu les caractéristiques environnementales en comparant tous les investissements directs à la politique d'exclusion du Fonds. Le Fonds a également promu des caractéristiques environnementales en s'engageant activement auprès des émetteurs sur les questions importantes liées au climat, qui ont inclus le fait d'encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les incidences du Fonds sur la durabilité ont été mesurées par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement auprès des émetteurs, ainsi que de sa stratégie d'exclusion. La stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds s'appliquent à 100 % de ses investissements directs.

Par exemple, le processus de présélection du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans le charbon et le pétrole non conventionnel (comme le pétrole arctique et les sables bitumineux). En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes acceptées à l'échelle mondiale telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies, le cas échéant.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande **proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir au 31 décembre 2022

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/07/2031	Titres liés à l'inflation	6,72 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,500 % échéance 15/01/2028	Titres liés à l'inflation	4,05 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/04/2025	Titres liés à l'inflation	3,56 %	États-Unis
Bon du Trésor britannique 1,250 % échéance 22/11/2032	Titres liés à l'inflation	3,18 %	Royaume-Uni
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,400 % échéance 26/05/2025	Titres liés à l'inflation	2,82 %	Italie
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,625 % échéance 15/04/2023	Titres liés à l'inflation	2,65 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/01/2030	Titres liés à l'inflation	2,61 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,250 % échéance 15/07/2029	Titres liés à l'inflation	2,56 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 1,625 % échéance 15/10/2027	Titres liés à l'inflation	2,52 %	États-Unis
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 1,300 % échéance 15/05/2028	Titres liés à l'inflation	2,31 %	Italie
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 3,625 % échéance 15/04/2028	Titres liés à l'inflation	2,29 %	États-Unis
Titres du Trésor américain protégés contre l'inflation 0,125 % échéance 15/04/2026	Titres liés à l'inflation	2,01 %	États-Unis
Obligation internationale du gouvernement japonais 0,100 % échéance 10/03/2029	Titres liés à l'inflation	1,79 %	Japon
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 3,000 % échéance 01/02/2053	Titrisé	1,71 %	États-Unis
Obligation internationale du gouvernement néo-zélandais 2,000 % échéance 20/09/2025	Titres liés à l'inflation	1,63 %	Nouvelle-Zélande

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la proportion du Fonds qui a promu les caractéristiques environnementales/sociales au 31 décembre 2022 sont fournies ci-dessous.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 31 décembre 2022, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant les caractéristiques environnementales, car la stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds ont été appliqués à tous ses investissements directs. Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
Titres liés à l'inflation	100,97 %
Autres instruments nets à duration courte	15,95 %
Titrisé	8,56 %
Obligations couvertes et Pfandbriefe	3,62 %
Investment Grade Credit	0,17 %
Marché émergent local	0,07 %
Crédit à haut rendement	0,04 %
Titres liés à un gouvernement	-29,38 %

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les participations du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisées.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Au 31 décembre 2022, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie européenne est de 0 %. Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un auditeur et n'a pas été examiné par un tiers.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE[1] ?

☐ **Oui :**

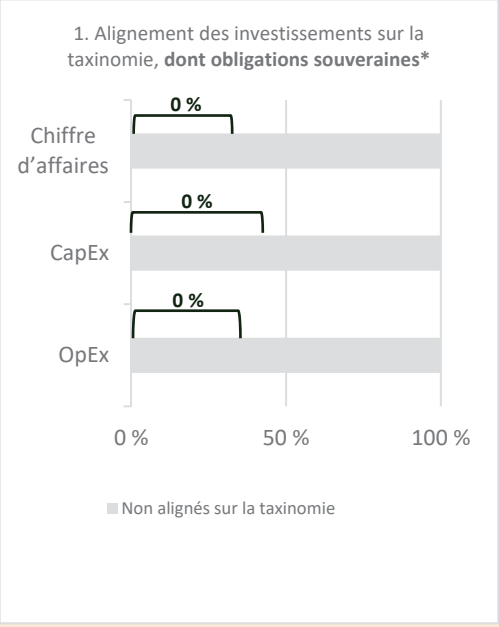
☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

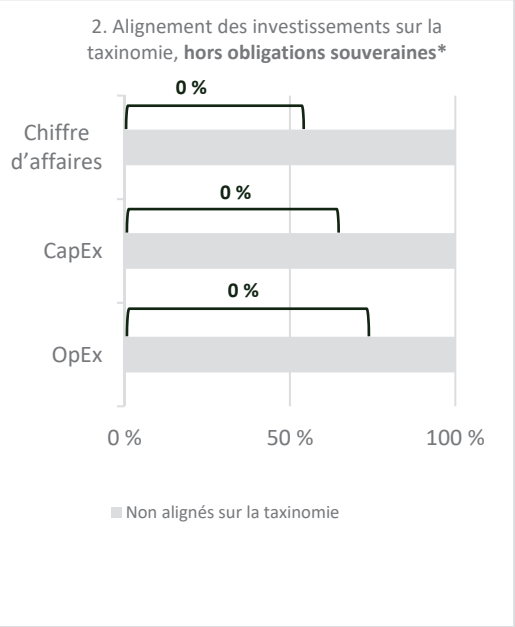
☑ **Non**

[1] Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autre que les obligations souveraines.





**Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines*

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 %.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2022, 100 % des investissements directs du Fonds ont été considérés comme promouvant les caractéristiques environnementales, car la stratégie d'exclusion et le processus de présélection des exclusions du Fonds ont été appliqués à tous ses investissements directs.

Des garanties environnementales ou sociales minimales ont été fournies pour ces investissements directs uniquement et ne s'appliquent pas aux investissements indirects.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé auprès des sociétés et des émetteurs sur des questions importantes liées au climat et a cherché à encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

ANNEXE IV

Modèle d'informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 *bis*, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit : Fonds Low Duration Opportunities ESG Fund **Identifiant d'entité juridique :** 549300M7ZPBX56GB2C41

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Par **investissement durable,** on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

☐ Oui	☑ Non
☐ **Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___ %**	☑ **Il promouvait des caractéristiques environnementales/sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de 29 % d'investissements durables**
☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE	☑ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
	☑ ayant un objectif social**
	** Bien que le Fonds ait investi dans des investissements durables ayant un objectif social au cours de la période couverte par le présent rapport, il n'a pris aucun engagement à investir dans cette catégorie d'investissements ; par conséquent, ces investissements acquis par le Fonds doivent être considérés comme accessoires par nature.
☐ **Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___ %**	☐ **Il promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

L'approche du Fonds en matière d'investissement durable passe par la promotion de caractéristiques environnementales et sociales (bien que le Fonds n'ait pas pour objectif l'investissement durable, il cherche à investir une partie de ses actifs dans des investissements durables).

Comme indiqué ci-dessous, les investissements durables détenus par le Fonds au cours de la période de référence ont contribué aux objectifs environnementaux d'adaptation au changement climatique et d'atténuation du changement climatique.

Les instruments dérivés détenus par le Fonds au cours de la période ont été contrôlés par rapport à la politique d'exclusion mise en œuvre par le Conseiller en investissement et ont donc été utilisés pour promouvoir les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les incidences du Fonds sur la durabilité ont été mesurées par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de sa politique d'engagement envers les émetteurs, de sa stratégie d'exclusion et de son investissement dans certains Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée **« Titres ESG à revenu fixe »**) qui permettent aux émetteurs de lever des capitaux pour financer des projets présentant des avantages pour l'environnement, ainsi que dans des titres de créance d'émetteurs ayant exercé un leadership dans la gestion des risques et des opportunités liés au changement climatique.

Par exemple, le processus de présélection du Fonds a entraîné l'exclusion de certains secteurs, notamment les émetteurs impliqués dans le charbon et le pétrole. En outre, dans le cadre du processus de présélection du Fonds, le Conseiller en investissement a fait référence à des normes mondialement acceptées, telles que les principes du Pacte mondial des Nations unies et les Principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme, le cas échéant.

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Les investissements durables sous-jacents du Fonds ont principalement contribué aux objectifs environnementaux d'atténuation du changement climatique et d'adaptation au changement climatique au cours de la période de référence, et ce, de diverses manières, y compris, à titre d'exemple, l'investissement dans des Titres ESG à revenu fixe (comme décrit plus en détail dans la section du Prospectus intitulée **« Titres ESG à revenu fixe »**), dont les obligations vertes.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

Les investissements durables du Fonds ont été évalués afin de s'assurer qu'ils ne causent pas de préjudice important à tout objectif environnemental ou social. Cette évaluation a été réalisée par la mise en œuvre, par le Conseiller en investissement, de divers indicateurs de durabilité défavorables, y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition au charbon et au pétrole et les émissions de gaz à effet de serre.

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Les titres ont été sélectionnés selon le processus de présélection interne du Conseiller en investissement en matière de durabilité. Ce processus de présélection comprend la prise en compte des incidences négatives sur les facteurs de durabilité, notamment l'exposition au secteur du charbon et du pétrole, ainsi qu'aux armes controversées. Le Conseiller en investissement a cherché à atténuer les principales incidences négatives, notamment par le biais de l'engagement auprès des émetteurs et de la présélection des exclusions.

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Le Conseiller en investissement s'est assuré que les investissements durables étaient alignés sur les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et sur les principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme par le biais d'une présélection des controverses du Pacte mondial des Nations unies ainsi que d'autres instruments, notamment les scores et les recherches ESG, dans le cadre du processus de diligence raisonnable des investissements.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et s'accompagne de critères spécifiques de l'Union.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.

Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences des décisions d'investissement qui « entraînent des répercussions négatives sur les facteurs de durabilité », les facteurs de durabilité étant définis comme « les questions environnementales, sociales et de personnel, le respect des droits de l'homme, la lutte contre la corruption et les actes de corruption ».

Le Fonds a pris en considération les principales incidences négatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité (y compris, mais sans s'y limiter, l'exposition au charbon et au pétrole, les émissions de gaz à effet de serre et l'exposition aux armes controversées) au cours de la période de référence.

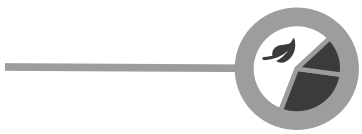
Le Conseiller en investissement a visé à prendre en considération les principales incidences négatives dans le cadre du processus d'investissement et a utilisé une combinaison de méthodes pour contribuer à atténuer les principales incidences négatives, y compris l'engagement auprès des émetteurs et les exclusions.

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir au 31 décembre 2022

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
Bons du Trésor américain 4,290 % échéance 09/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	28,19 %	États-Unis
Bons du Trésor américain 4,245 % échéance 02/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	16,13 %	États-Unis
Bons du Trésor japonais (0,198) % échéance 27/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	6,31 %	Japon
Bons du Trésor japonais (0,179) % échéance 27/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	4,46 %	Japon
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 3,500 % échéance 01/02/2053	Titrisé	4,06 %	États-Unis
Bons du Trésor autrichiens 1,267 % échéance 23/02/2023	Autres instruments nets à duration courte	2,16 %	Autriche
St. Paul's CLO DAC 2,128 % échéance 15/01/2032	Autres instruments nets à duration courte	2,12 %	Irlande
NatWest Group PLC 4,067 % échéance 06/09/2028	Investment Grade Credit	2,11 %	Royaume-Uni
Mizuho Financial Group, Inc. 3,490 % échéance 05/09/2027	Investment Grade Credit	2,11 %	Japon
Bons du Trésor américain 4,397 % échéance 23/03/2023	Autres instruments nets à duration courte	2,01 %	États-Unis
Mizuho Financial Group, Inc. 0,214 % échéance 07/10/2025	Investment Grade Credit	1,99 %	Japon
NTT Finance Corp. 0,082 % échéance 13/12/2025	Investment Grade Credit	1,97 %	Japon
Titre adossé à des créances hypothécaires uniforme (UMBS), TBA 3,000 % échéance 01/02/2053	Titrisé	1,43 %	États-Unis
Banque européenne d'investissement 2,375 % échéance 24/05/2027	Titres liés à un gouvernement	1,26 %	Supranationales
Bank of America Corp. 2,456 % échéance 22/10/2025	Investment Grade Credit	1,00 %	États-Unis

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

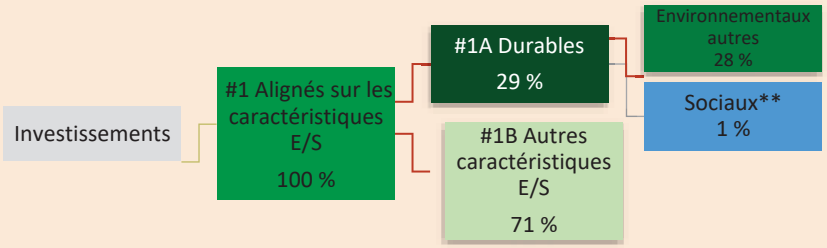


Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Des informations sur la proportion du Fonds qui a promu des caractéristiques environnementales et/ou sociales et la proportion du Fonds investie dans des investissements durables au 31 décembre 2022 sont fournies ci-dessous.

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était l'allocation des actifs ?



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **# 1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :
- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne **l'énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les activités habilitantes permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les activités transitoires sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Au 31 décembre 2022, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et sociales, car tous les investissements du Fonds ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion.

À cette date, le Fonds a investi 29 % de son actif net dans des investissements durables. 28 % de l'actif net ont été investis dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif environnemental.

**Le Fonds détenait également 1 % de son actif net dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social. Il convient de noter que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social et que ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% de l'investissement
Autres instruments nets à duration courte	34,60 %
Investment Grade Credit	29,83 %
Titres liés à un gouvernement	26,08 %
Titrisé	5,50 %
Crédit à haut rendement	4,00 %

Aux fins de la compilation des informations susmentionnées, les investissements du Fonds au 31 décembre 2022 ont été utilisés.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Au 31 décembre 2022, le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie européenne est de 0 %. Ce chiffre n'a pas fait l'objet d'une assurance fournie par un auditeur et n'a pas été examiné par un tiers.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE[1] ?

☐ **Oui :**

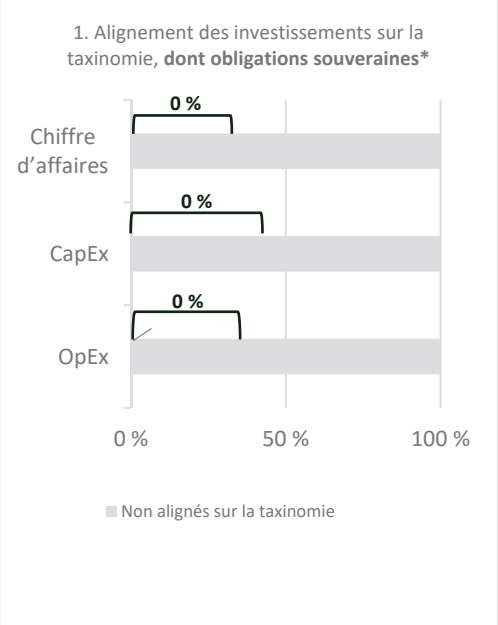
☐ Dans le gaz fossile ☐ Dans l'énergie nucléaire

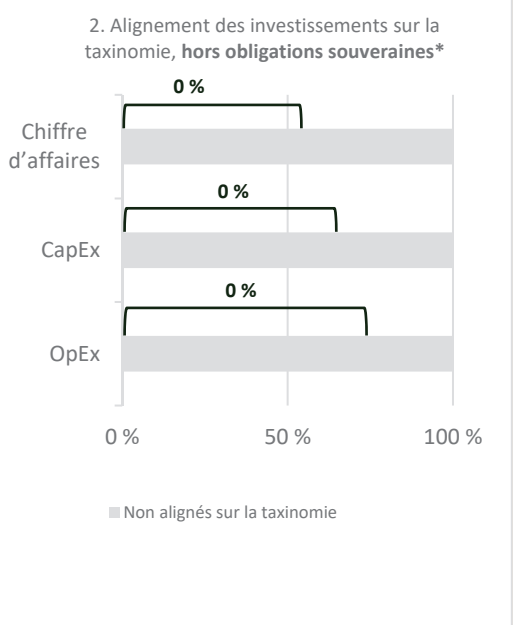
☑ **Non**

[1] Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE - voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- **du chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- **des dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- **des dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autre que les obligations souveraines.





Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines

Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?

Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements du Fonds réalisés dans des activités transitoires et habilitantes au cours de la période de référence était de 0 %.

Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020 /852.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Le Fonds ne s'engage pas à investir dans des investissements alignés sur la taxinomie de l'UE, mais s'engage à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif environnemental. Au 31 décembre 2022, la proportion d'investissements durables du Fonds qui ont contribué à un objectif environnemental sans être évalués par rapport à la taxinomie de l'UE et qui, par conséquent, étaient classés dans la catégorie « Environnementaux autres » ci-dessus est de 28 %. Pour de plus amples informations concernant la disponibilité des données relatives à la durabilité et les défis associés, veuillez consulter le site https://europe.pimco.com/en-eu/our-firm/global-advisors-ireland.

Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Comme indiqué ci-dessus, le Fonds détenait 1 % de son actif net dans des investissements durables qui ont contribué à un objectif social au cours de la période couverte par les présents états financiers. Étant donné que le Fonds n'a pris aucun engagement à investir dans des investissements durables qui contribuent à un objectif social, ces investissements doivent être considérés comme accessoires par nature.

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?

Comme indiqué ci-dessus, au 31 décembre 2022, 100 % des investissements du Fonds ont été considérés comme promouvant des caractéristiques environnementales et sociales, car tous les investissements du Fonds ont été contrôlés par rapport à sa stratégie d'exclusion. Comme indiqué plus en détail ci-dessus, à cette date, le Fonds a investi 29 % de son actif net dans des investissements durables.

Par conséquent, au 31 décembre 2022, aucun investissement au sein du portefeuille était non aligné sur les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds.

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Au cours de la période de référence, le Conseiller en investissement s'est engagé auprès des sociétés et des émetteurs sur des questions importantes liées au climat et a cherché à encourager des sociétés à s'aligner sur l'Accord de Paris, à adopter des objectifs scientifiques de réduction des émissions de carbone et/ou à faire progresser de manière générale leurs engagements en matière de durabilité.

Glossaire : (abréviations susceptibles d'être utilisées dans les états qui précèdent) (non auditées)

Abréviations des contreparties :

AZD	Australia and New Zealand Banking Group	**FAR**	Wells Fargo Bank National Association	**MYI**	Morgan Stanley & Co. International PLC
BOA	Bank of America N.A.	**FBF**	Credit Suisse International	**NAB**	National Australia Bank Ltd.
BOM	Bank of Montreal	**FCT**	Credit Suisse Capital LLC	**NOM**	Nomura Securities International, Inc.
BOS	BofA Securities, Inc.	**FICC**	Fixed Income Clearing Corporation	**NXN**	Natixis New York
BPG	Paribas Securities Corp.	**GLM**	Goldman Sachs Bank USA	**PER**	Pershing LLC
BPS	Paribas S.A.	**GRE**	NatWest Markets Securities, Inc.	**RBC**	Royal Bank of Canada
BRC	Barclays Bank PLC	**GSC**	Goldman Sachs & Co. LLC	**RCY**	Royal Bank of Canada
BSH	Banco Santander S.A. - Succursale de New York	**GST**	Goldman Sachs International	**RDR**	RBC Capital Markets LLC
BSN	The Bank of Nova Scotia - Toronto	**HUS**	HSBC Bank USA N.A.	**RVM**	Barclays Capital, Inc.
BSS	Banco Santander S.A.	**IND**	Crédit Agricole Corporate and Investment Bank S.A.	**RYL**	NatWest Markets Plc
BYL	Barclays Bank PLC, succursale de Londres	**JLN**	JP Morgan Chase Bank N.A. Londres	**SAL**	Citigroup Global Markets, Inc.
BYR	The Bank of Nova Scotia - Toronto	**JML**	JP Morgan Securities Plc	**SCX**	Standard Chartered Bank, Londres
CBK	Citibank N.A.	**JPM**	JP Morgan Chase Bank N.A.	**SGY**	Société Générale, NY
CDI	Natixis Singapore	**JPS**	J.P. Morgan Securities LLC	**SOG**	Société Générale Paris
CIB	Canadian Imperial Bank of Commerce	**MAC**	Macquarie Bank Limited	**SSB**	State Street Bank and Trust Co.
CKL	Citibank N.A. Londres	**MBC**	HSBC Bank Plc	**TDM**	TD Securities (USA) LLC
CLY	Credit Agricole Corporate and Investment Bank	**MEI**	Merrill Lynch International	**TOR**	The Toronto-Dominion Bank
COM	Commerz Bank AG	**MFK**	Barclays Capital, Inc.	**UAG**	UBS AG Stamford
CSN	Credit Suisse AG (New York)	**MSC**	Morgan Stanley & Co. LLC.	**UBS**	UBS Securities LLC
DBL	Deutsche Bank AG London	**MYC**	Morgan Stanley Capital Services LLC	**WST**	Westpac Banking Corp.
DUB	Deutsche Bank AG				
DEU	Deutsche Bank Securities, Inc.				

Abréviations des devises :

AED	Dirham des EAU	**HKD**	Dollar de Hong Kong	**PLN**	Zloty polonais
ARS	Peso argentin	**HUF**	Forint hongrois	**RON**	Nouveau leu roumain
AUD	Dollar australien	**IDR**	Roupie indonésienne	**RSD**	Dinar serbe
BRL	Réal brésilien	**ILS**	Shekel israélien	**RUB**	Rouble russe
CAD	Dollar canadien	**INR**	Roupie indienne	**SEK**	Couronne suédoise
CHF	Franc suisse	**JPY (ou ¥)**	Yen japonais	**SGD**	Dollar de Singapour
CLP	Peso chilien	**KES**	Shilling kényan	**THB**	Baht thaïlandais
CNH	Renminbi chinois (Offshore)	**KRW**	Won sud-coréen	**TRY**	Nouvelle livre turque
CNY	Renminbi chinois (Chine continentale)	**KZT**	Tenge kazakh	**TWD**	Dollar de Taïwan
COP	Peso colombien	**MXN**	Peso mexicain	**UAH**	Hryvnia ukrainienne
CZK	Couronne tchèque	**MYR**	Ringgit malaisien	**UGX**	Shilling ougandais
DKK	Couronne danoise	**NGN**	Naira nigérian	**USD (ou $)**	Dollar américain
DOP	Peso dominicain	**NOK**	Couronne norvégienne	**UYU**	Peso uruguayen
EGP	Livre égyptienne	**NZD**	Dollar néo-zélandais	**VND**	Dong vietnamien
EUR (ou €)	Euro	**PEN**	Nouveau Sol péruvien	**ZAR**	Rand sud-africain
GBP (ou £)	Livre sterling	**PHP**	Peso philippin	**ZMW**	Kwacha zambien
GHS	Cedi ghanéen				

Abréviations des marchés de change :

BIST	Borsa Instanbul Exchange	**CME**	Chicago Mercantile Exchange	**Marché hors cote**	Marché hors cote
CBOE	Chicago Board Options Exchange	**FTSE**	Financial Times Stock Exchange		

Abréviations des indices/spread :

ABX.HE	Indice Asset-Backed Securities – Home Equity	**DAX**	Indice Deutscher Aktien 30	**PIMCODBU**	PIMCO Custom Commodity Basket
ACS	Indice Algonquin Cityfates Natural Gas Basis Futures	**FRCPXTOB**	Indice France Consumer Price ex-Tobacco	**PrimeX.ARM**	Indice Prime Mortgage-Backed Securities – Adjustable Rate Mortgage
BCOMF1TC	Indice Bloomberg Commodity 1-Month Forward Total Return	**FTSE/JSE**	Indice South African Performance	**500 S&P**	Indice Standard & Poor's 500
BCOMTR	Indice Bloomberg Commodity Total Return	**FTSE/MIB**	Indice Borsa Italiana's 40 Most Liquid/ Capitalised Italian Shares Equity Index	**S&P CNX Nifty**	Indice Standard & Poor's Nifty 50
BCOMTR2	Indice Bloomberg Custom Commodity Index	**35 IBEX**	Indice Spanish Continuous Exchange	**SIBCSORA**	Taux moyen au jour le jour de Singapour
CAC	Cotation Assistée en Continu	**IBR**	Indicador Bancario de Referencia	**SOFR**	Taux de financement au jour le jour garanti
CDX.EM	Indice Credit Derivatives – Emerging Markets	**JMABDEWU/ JPPMGSHP**	Indice J.P. Morgan Custom Commodity	**SONIO**	Taux moyen interbancaire au jour le jour en livre sterling
CDX.HY	Indice Credit Derivatives – High Yield	**JMABNIU5**	Indice J.P. Morgan Custom Commodity	**200 SPI**	Indice Australian Equity Futures
CDX.IG	Indice Credit Derivatives – Investment Grade	**JPPMGSHP**	Indice JP Morgan Custom Commodity Index	**SRFXON3**	Taux moyen au jour le jour de Suisse (18 h)
CIXBSTR3	Indice Custom Commodity	**KOSPI**	Indice Korea Composite Stock Price	**SX4T**	Indice EURO STOXX Chemicals Index
CMBX	Indice Commercial Mortgage-Backed	**KOSPI2**	Indice de la Bourse coréenne KOSPI 200	**TOPIX**	Indice Tokyo Price
CNREPOFIX	Taux des prises en pension Chine à 7 jours	**MUCKCALM**	Taux moyen au jour le jour de Tokyo	**TRNGLU**	Indice FTSE EPRA/NAREIT Developed Net TRI USD
CPALEMU	Indice Euro Area All Items Non-Seasonally Adjusted	**NASDAQ**	NASDAQ (National Association of Securities Dealers Automated Quotations)	**IPC Royaume-Uni**	Indice United Kingdom Retail Prices
CPTFEMU	Eurozone HICP ex-Tobacco Index	**NDUEACWF**	MSCI ACWI Index Future	**VSTOXX**	Euro Stoxx 50 Volatility Index
CPURNSA	Consumer Price All Urban Non-Seasonally Adjusted Index	**OMXS30**	Stockholm 30 Index	**WIG20**	Capitalization-weighted Stock Market Index of the 20 largest companies on the Warsaw Stock Exchange

Municipal Bond or Agency Abbreviations:

AGM	Assured Guaranty Municipal

Autres abréviations :

ABS	Titre adossé à des actifs	**ESTRON EUR**	Taux à court terme en euro	**PRIBOR**	Taux interbancaire offert à Prague
ALT	Alternate Loan Trust	**EURIBOR**	Taux interbancaire offert en Euro	**REIT**	Fonds d'investissement immobilier
ATM	À parité	**HIBOR**	Taux interbancaire offert à Hong Kong	**REMIC**	Real Estate Mortgage Investment Conduit
BABs	Build America Bonds	**JIBAR**	Taux interbancaire convenu à Johannesburg	**RMBS**	Titre adossé à des hypothèques résidentielles
BBR	Taux sur effets commerciaux de banque	**JSC**	Joint Stock Company	**STIBOR**	Taux interbancaire offert à Stockholm
BBSW	Bank Bill Swap Reference Rate	**KLIBOR**	Taux interbancaire offert à Kuala Lumpur	**TAIBOR**	Taux interbancaire offert à Taipei
BRL-CDI	Brazil Interbank Deposit Rate	**KORIBOR**	Taux interbancaire offert en Corée	**TBA**	À annoncer
BTP	Buoni del Tesoro Poliennali « obligation du Trésor à long terme »	**LIBOR**	Taux interbancaire offert à Londres	**À définir**	À déterminer
CBO	Obligation garantie (Collateralised Bond Obligation)	**MIBOR**	Taux interbancaire offert à Mumbai	**TBD%**	Le taux d'intérêt est fixé lors du règlement du prêt ou au moment du financement
CDI	Brazil Interbank Deposit Rate	**MSCI**	Morgan Stanley Capital International	**TELBOR**	Taux interbancaire offert à Tel-Aviv
CDO	Obligation garantie (Collateralised Debt Obligation)	**NIBOR**	Taux interbancaire offert en Norvège	**THBFIX**	Thai Baht Floating-Rate Fix
CHILIBOR	Taux interbancaire offert au Chili	**OAT**	Obligations Assimilables du Trésor	**THORON THB**	Taux de rachat au jour le jour thaïlandais
CLO	Prêt garanti (Collateralised Loan Obligation)	**OIS**	Overnight Index Swap	**TIIE**	Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio « Equilibrium Interbank Interest Rate »
CMBS	Titre adossé à des hypothèques	**PIK**	Paiement en nature	**WIBOR**	Taux interbancaire offert à Varsovie
DAC	Designated Activity Company				

GESTIONNAIRE
PIMCO Global Advisors (Ireland) Limited,
Third Floor,
Harcourt Building,
Harcourt Street,
Dublin,
D02 F721,
Irlande.

CONSEILLERS EN INVESTISSEMENT
Pacific Investment Management Company LLC,
650 Newport Center Drive,
Newport Beach, Californie 92660,
États-Unis.

PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
Londres W1U 3AH,
Royaume-Uni.

PIMCO Asia Pte Ltd.,
8 Marina View, #30-01,
Asia Square Tower 1,
Singapour 018960.

PIMCO Europe GmbH,
Seidlstrasse 24-24a,
80335 Munich,
Allemagne.

AGENT ADMINISTRATIF
State Street Fund Services (Ireland) Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 HD32,
Irlande.

DÉPOSITAIRE
State Street Custodial Services (Ireland) Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 HD32,
Irlande.

DISTRIBUTEURS
PIMCO Europe GmbH,
Seidlstrasse 24-24a,
80335 Munich,
Allemagne.

PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
Londres W1U 3AH,
Royaume-Uni.

PIMCO Asia Pte Ltd.,
8 Marina View, #30-01,
Asia Square Tower 1,
Singapour 018960.

PIMCO Asia Limited,
22nd Floor, Suite 2201,
Two International Finance Centre,
8 Finance Street, Central,
Hong Kong.

PIMCO Australia Pty Ltd.,
Level 19, 5 Martin Place,
363 George Street,
Sydney, New South Wales 2000,
Australie.

SERVICE DE PAIEMENT POUR L'AUTRICHE
UniCredit Bank Austria AG,
Schottengasse 6-8,
1010 Vienne,
Autriche.

REPRÉSENTANT À SINGAPOUR
PIMCO Asia Pte Ltd.,
8 Marina View, #30-01,
Asia Square Tower 1,
Singapour 018960.

BANQUES CORRESPONDANTES EN ITALIE
Allianz Bank Financial Advisors S.p.A.,
Piazza Velasca, 7/9,
20122 Milan,
Italie.

State Street Bank International GmbH – Succursale Italia,
Via Ferrante Aporti, 10,
Milan,
Italie.

Société Générale Securities Services S.p.A. (« SGSS »),
Via Santa Chiara, 19,
Turin,
Italie.

AllFunds Bank S.A.U.,
Succursale di Milano,
Via Bocchetto, 6,
20123 Milan,
Italie.

Banca Sella Holding S.p.A.,
Piazza Gaudenzio Sella, 1,
13900 Biella,
Italie.

Monte dei Paschi di Siena S.p.A.,
Via Verii, 14,
Mantova,
Italie.

RBC Investor Services Bank S.A., succursale de Milan,
Via Vittor Pisani, 26,
20124 Milano,
Italie.

CACEIS Bank, succursale italienne,
Piazza Cavour 2,
20121 Milano,
Italie.

REPRÉSENTANT À HONG KONG
PIMCO Asia Limited,
22nd Floor, Suite 2201,
Two International Finance Centre,
8 Finance Street,
Hong Kong.

SERVICE DE PAIEMENT ET DE REPRÉSENTATION AU LUXEMBOURG
Société Générale Luxembourg,
(Centre opérationnel / FED),
28-32, Place de la Gare,
L-1616, Luxembourg.

SERVICE DE PAIEMENT ET DE REPRÉSENTATION EN SUISSE
BNP PARIBAS Paris,
Succursale de Zurich,
Selnaustrasse 16,
8002 Zurich,
Suisse.

REPRÉSENTANT AU ROYAUME-UNI
PIMCO Europe Ltd.,
11 Baker Street,
Londres W1U 3AH,
Royaume-Uni.

SERVICE DE PAIEMENT EN BELGIQUE
ABN AMRO BANK S.A.,
Borsbeeksebrug 30,
2600 Anvers,
Belgique.

SERVICE DE PAIEMENT ET D'INFORMATION EN ALLEMAGNE
Marcard, Stein & Co AG,
Ballindamm 36,
20095 Hambourg,
Allemagne.

SERVICE DE PAIEMENT AU PORTUGAL
Banco Activobank (Portugal) S.A.,
Rua Augusta 86,
1149-023, Lisbonne,
Portugal.

SERVICE DE PAIEMENT EN SUÈDE
SEB Merchant Banking,
SE-106 40,
Stockholm,
Suède.

SERVICE DE PAIEMENT EN GRÈCE
Eurobank Asset Management M.F.M.C.,
10 Stadiou Street,
GR 10564 Athènes,
Grèce.

SERVICE DE PAIEMENT EN HONGRIE
European Investment Centre,
Tomasikova 64,
831 04 Bratislava,
République slovaque.

SERVICE DE PAIEMENT EN RÉPUBLIQUE TCHÈQUE
European Investment Centre,
Veveří 2581/102,
616 00 Brno,
République tchèque.

AGENT CENTRALISATEUR ET FINANCIER FRANÇAIS
Société Générale,
29, Boulevard Haussmann,
75009 Paris,
France.

SERVICE DE PAIEMENT AU LIECHTENSTEIN
LGT Bank Ltd.,
Herrengasse 12,
FL-9490 Vaduz,
Liechtenstein.

SERVICE DE PAIEMENT À CHYPRE
EUROBANK CYPRUS LTD.,
28, Spyrou Kyprianou Avenue,
1075 Nicosie,
Chypre.

CONSEILLERS JURIDIQUES EN DROIT IRLANDAIS
Dillon Eustace LLP,
33 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 XK09,
Irlande.

CONSEILLERS JURIDIQUES EN MATIÈRE DE DROIT AMÉRICAIN
Dechert LLP,
1900 K Street N.W.,
Washington, D.C. 20006,
États-Unis.

COMMISSAIRES AUX COMPTES INDÉPENDANTS
PricewaterhouseCoopers
Chartered Accountants and Statutory Audit Firm,
One Spencer Dock,
North Wall Quay,
Dublin 1,
D01 X9R7,
Irlande.

SECRÉTAIRE
State Street Fund Services (Ireland) Limited,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 HD32,
Irlande.

COURTIER PROMOTEUR
Dillon Eustace LLP,
33 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 XK09,
Irlande.

SIÈGE SOCIAL
PIMCO Funds: Global Investors Series plc,
78 Sir John Rogerson's Quay,
Dublin 2,
D02 HD32,
Irlande.

ADMINISTRATEURS DE LA SOCIÉTÉ ET DU GESTIONNAIRE
V. Mangala Ananthanarayanan[1] (Inde)
Ryan P. Blute[1] (États-Unis)
John Bruton (Administrateur indépendant) (Irlande)
Craig A. Dawson[1] (États-Unis)
David M. Kennedy (Administrateur indépendant) (Irlande)
Frances Ruane (Administratrice indépendante) (Irlande)

Le Prospectus, les suppléments au Prospectus, l'Acte constitutif et les Statuts de la Société, ainsi que les Documents d'information clé pour l'investisseur et les rapports annuels et semestriels sont disponibles gratuitement auprès du représentant ou de l'agent de chaque juridiction.

Les actionnaires peuvent obtenir gracieusement une copie des changements apportés au portefeuille au cours de l'exercice clos le 31 décembre 2022 auprès du Dépositaire ou des Agents payeurs, de l'Agent payeur et d'information en Allemagne et du Représentant suisse.

[1] Salarié de PIMCO.

PIMCO Europe Ltd (société immatriculée sous le n° 2604517) est agréée et régie par la Financial Conduct Authority (12 Endeavour Square, Londres, E20 1JN) au Royaume-Uni. Les services fournis par PIMCO Europe Ltd ne sont pas accessibles aux particuliers, qui ne doivent pas se fier à la présente communication, mais contacter leur conseiller financier.

PIMCO Europe GmbH (société immatriculée sous le n° 192083, Seidlstr. 24-24a, 80335 Munich, Allemagne), PIMCO Europe GmbH succursale italienne (société immatriculée sous le n° 10005170963), PIMCO Europe GmbH succursale irlandaise (société immatriculée sous le n° 909462), PIMCO Europe GmbH succursale britannique (société immatriculée sous le n° 2604517) et PIMCO Europe GmbH succursale espagnole (N.I.F. W2765338E) sont autorisées et réglementées par l'autorité de surveillance allemande des services financiers (BaFin) (Marie- Curie-Str. 24-28, 60439 Francfort-sur-le-Main) en Allemagne conformément à la Section 15 de la Loi allemande sur les institutions de valeurs mobilières (WpIG). La succursale italienne, la succursale irlandaise, la succursale britannique et la succursale espagnole sont également supervisées par : (1) succursale italienne : la Commissione Nazionale per le Società e la Borsa (CONSOB) conformément à l'Article 27 de la Loi financière consolidée italienne ; (2) succursale irlandaise : la Banque centrale d'Irlande conformément au Règlement 43 de l'Union européenne (marchés d'instruments financiers) de 2017, tel qu'amendé ; (3) succursale britannique : la Financial Conduct Authority ; et (4) la succursale espagnole : la Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) conformément aux obligations stipulées aux articles 168 et 203 à 224, ainsi qu'aux obligations contenues dans le Tile V, Section I de la Loi sur le marché des valeurs mobilières (LSM) et aux articles 111, 114 et 117 du Décret royal 217/2008, respectivement. Les services fournis par PIMCO Europe GmbH ne sont offerts qu'aux professionnels tels que définis à l'Article 67, alinéa 2 de la Loi allemande sur le commerce des valeurs mobilières (WpHG). Ils ne sont pas accessibles aux épargnants, qui ne doivent pas se fier à la présente communication.

PIMCO (Schweiz) GmbH (enregistrée en Suisse sous le numéro CH-020.4.038.582-2). Les services fournis par PIMCO (Schweiz) GmbH ne sont pas accessibles aux particuliers, qui ne doivent pas se fier à la présente communication, mais contacter leur conseiller financier.